

Entrenamiento Especializado

Fundamentación para la Gestión Cuantitativa de Riesgos.

Descripción

En este entrenamiento se abordará desde un enfoque sencillo y práctico los diferentes tipos de riesgo ofreciendo al participante herramientas que le permitirán complementar los conocimientos en la administración y la gestión del riesgo.

Al final del entrenamiento usted contará con información suficiente para solucionar casos habituales como:

- Modelación de la incertidumbre a partir de Distribuciones de Probabilidad.
- Evaluar Decisiones de Inversión a partir del VAN y la TIR Bajo Incertidumbre
- Realizar pronósticos de Variables Inciertas
- Optimizar Decisiones de Inversión de Proyectos y Portafolios
- Evaluación de Inversiones a través de Árboles de Decisión

Dirigido a

Profesionales, directores, analistas, docentes, Investigadores y en general para todas las personas que trabajen o estén interesadas en la Implementación de técnicas y conceptos referentes a la gestión y cuantificación de Riesgos.

Objetivo

1. Introducir al participante en Técnicas de Simulación por múltiples escenarios.
2. Analizar e interpretar resultados estadísticos de manera gráfica y numérica.
3. Mostrar al participante la importancia de la Gestión de Riesgos en presencia de Incertidumbre.
4. Entender la simulación de Monte Carlo como metodología para la modelación de incertidumbre en las Decisiones de Inversión.
5. Proporcionar procedimientos para realizar un análisis integrado de riesgos a través del uso de herramientas especializadas como Risk Simulator.

Temario

El Concepto de Riesgo: ¿Qué es y Por qué nos Interesa Conocerlo?

Definición de Riesgo

El Riesgo y las Decisiones Estratégicas

Importancia de la cuantificación de Riesgos
Clasificación de Riesgos
Metodología de Gestión Integral de Riesgos (GIR)

Conceptos de Estadística para la Gestión Cuantitativa de Riesgos

Medidas de Localización
Medidas de Variabilidad
Medidas de Distribución y ubicación relativa
Medidas de Asociación Lineal y no Lineal
Introducción a la Probabilidad
Distribuciones para simular Variables Aleatorias Discretas
Distribuciones para simular Variables Aleatorias Continuas
Intervalos de Confianza
Pruebas de Hipótesis

El Concepto de Riesgo: ¿Qué es y Por qué nos Interesa Conocerlo?

Definición de Riesgo
El Riesgo y las Decisiones Estratégicas
Importancia de la cuantificación de Riesgos
Clasificación de Riesgos
Metodología de Gestión Integral de Riesgos (GIR)

Conceptos de Estadística para la Gestión Cuantitativa de Riesgos

Medidas de Localización
Medidas de Variabilidad
Medidas de Distribución y ubicación relativa
Medidas de Asociación Lineal y no Lineal
Introducción a la Probabilidad
Distribuciones para simular Variables Aleatorias Discretas
Distribuciones para simular Variables Aleatorias Continuas
Intervalos de Confianza
Pruebas de Hipótesis

Modelado de Situaciones para la Toma de Decisiones y la Gestión Cuantitativa de Riesgos

Análisis de Punto único
Análisis de Sensibilidad Estático
Análisis de Simulación de Monte Carlo
Análisis de Sensibilidad Dinámico
Análisis de Escenarios

Tipos de Optimización para la Toma de Decisiones y la Gestión Cuantitativa del Riesgo

Optimización Estática
Optimización Dinámica
Optimización Estocástica

Elaboración de Pronósticos para la Toma de Decisiones y la Gestión Cuantitativa del Riesgo

Componentes y Patrones de una Serie de Tiempo
Desestacionalizar una Serie de Tiempo
Técnicas de Suavizamiento
Metodología Box-Jenkins
Modelo de Regresión Lineal Simple y Múltiple
Modelo de Regresión Logística
Modelos de Volatilidad Condicional

Opciones Reales: Alternativa para la Valoración de Proyectos de Inversión

¿Qué son las Opciones Reales?

Comparación entre Opciones Financieras y Reales

Variables que determinan el Precio de una Opción Real

Metodologías para el Cálculo de la Opción

- Black-Scholes
- Simulación de Monte Carlo
- Árboles Binomiales

Instructores

Wilmer Ramírez

Ingeniero financiero de la Universidad Piloto de Colombia, acreditado con la Certificación Internacional en Administración Cuantitativa de Riesgos CQRM, con formación en Bloomberg, auditoría interna ISO 9001, NIC (Normas Internacionales de Contabilidad) y NIIF (Normas Internacionales de Información Financiera). Cuenta con experiencia en solución de problemas en áreas administrativas, contables y financieras en empresas del sector real y estatal. Actualmente se desempeña como instructor especializado del área de Riesgo y Finanzas en Software Shop

Miguel Ángel Bello Bernal, Mag.

Instructor de econometría y riesgo en Software Shop para Latinoamérica, economista de la Universidad de la Salle, con Maestría en Administración y Dirección de Empresas de la Universidad Villanueva en Madrid-España, actualmente está cursando la Maestría en Finanzas Cuantitativas en la Universidad del Rosario en Colombia. Se ha desempeñado como profesor de estadística, toma de decisiones y econometría financiera en especializaciones y maestrías en varias Universidades de Colombia, como: CESA, Universidad del Norte, Universidad del Rosario, Universidad EAFIT, Universidad Piloto y Universidad Jorge Tadeo Lozano. Ha impartido entrenamientos especializados en materia de análisis de riesgos en entidades internacionales como: Comisión Nacional de Acreditación (Chile); Ministerio de Economía y Finanzas del Perú, OSITRAN, Organismo de Evaluación y Fiscalización Ambiental del Perú (Perú); Banco Económico de Bolivia, Banco Fossil S.A., Universidad Privada de Santa Cruz (Bolivia); Superintendencia de Industria y Comercio, Fondo Nacional del Ahorro, Grupo Saludcoop, La Equidad Seguros, FINDETER S.A., Bolsa de Valores de Colombia, Cámara Colombiana de Infraestructura, Universidad EAFIT, Fundación Universidad de América (Colombia); Banco Central de Costa Rica, Banco Popular y de Desarrollo Comunal de Costa Rica (Costa Rica).

Información General

Duración

26 Horas

Fecha de Inicio

Sáb. 28 de Abr de 2018

Horarios

Fechas:

Abril 28, 30, Mayo 7, 10, 12, 14, 17 y 19 de 2018

Programación de las sesiones:

Lunes y Jueves - 3 horas por sesión

Sábados - 4 horas por sesión

Hora de inicio por país - Lunes y jueves

4:00 p.m. San José de Costa Rica

5:00 p.m. Bogotá - Lima - Quito - CDMX

6:00 p.m. La Paz

7:00 p.m. Buenos Aires - Santiago de Chile

Hora de inicio por país Sábados

08:00 a.m. San José de Costa Rica

09:00 a.m. Bogotá - Lima - Quito - CDMX

10:00 a.m. La Paz

11:00 a.m. Buenos Aires - Santiago de Chile



Políticas

Para conocer en detalle las condiciones y políticas de participación en los eventos, ingrese a nuestro link <https://www.software-shop.com/formacion/politicas>

Inscríbete ahora