Entrenamiento Especializado

Fundamentación para la Gestión Cuantitativa de Riesgos.

Descripción

<span style="font-family: Arial; color: rgb(0, 0, 0); background-color: transparent; font-weight: 400; font-style: normal; font-variant: normal; text-decoration: none; vertical-align: baseline; white-space: pre-wrap;">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. <span style="font-family: Arial; color: rgb(0, 0, 0); background-color: transparent; font-weight: 400; font-style: normal; font-variant: normal; text-decoration: none; vertical-align: baseline; white-space: pre-wrap;"> <span style="font-family: Arial; color: rgb(0, 0, 0); background-color: transparent; font-weight: 400; font-style: normal; font-variant: normal; text-decoration: none; vertical-align: baseline; white-space: pre-wrap;">Al final del entrenamiento usted contará con información suficiente para solucionar casos habituales como:
 - Modelación de la incertidumbre a partir de Distribuciones de Probabilidad. <span style="font-family: Arial; color: rgb(0, 0, 0); background-color: transparent; font-weight: 400; font-style: normal; font-variant: normal; text-decoration: none; vertical-align: baseline; white-space: pre-wrap;">- Evaluar Decisiones de Inversión a partir del VAN y la TIR Bajo Incertidumbre <span style="font-family: Arial; color: rgb(0, 0, 0); background-color: transparent; font-weight: 400; font-style: normal; font-variant: normal; text-decoration: none; vertical-align: baseline; white-space: pre-wrap;">- Realizar pronósticos de Variables Inciertas <span style="font-family: Arial; color: rgb(0, 0, 0); background-color: transparent; font-weight: 400; font-style: normal; font-variant: normal; text-decoration: none; vertical-align: baseline; white-space: pre-wrap;">- Optimizar Decisiones de Inversión de Proyectos y Portafolios <span style="font-family: Arial; color: rgb(0, 0, 0); background-color: transparent; font-weight: 400; font-style: normal; font-variant: normal; text-decoration: none; vertical-align: baseline; white-space: pre-wrap;">- Evaluación de Inversiones a través de Árboles de Decisión <span style="font-size:11pt;font-family:Arial;color:#000000;background-color:transparent;font-weight:400;font-style:normal;font-variant:normal;text-decoration:none;vertical-align:baseline;white-space:pre;white-space:pre-wrap;">
 <span style="font-size:11pt;font-family:Arial;color:#000000;background-color:transparent;font-weight:400;font-style:normal;font-variant:normal;text-decoration:none;vertical-align:baseline;white-space:pre;white-space:pre-wrap;">

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

Economista de la Universidad de la Salle y MBA de la Universidad Villanueva en España. Actualmente, está acreditado con la Certificación Internacional en Gestión de Riesgos-CQRM impartida por el Dr. Johnathan Mun. Consultor y formador especialista en Software Shop. Profesor de estadística, econometría y analitica de

datos, a nivel de pregrado y posgrado en el Colegio de Estudios Superiores de Administración (CESA) y otras universidades de Colombia. Cuenta con 7 años de experiencia como conferencista y capacitador internacional en análisis de riesgo y métodos cuantitativos para mejorar la toma de decisiones bajo escenarios de incertidumbre.

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

Herramientas de apoyo

Risk Simulator

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