

Entrenamiento Especializado

Entrenamiento online: Principales Herramientas Analíticas para el Análisis Cuantitativo de Riesgos

Descripción

El entrenamiento abordará desde un enfoque sencillo, teórico y práctico, las diferentes herramientas incorporadas en Risk Simulator para el análisis cuantitativo de riesgos.

Dirigido a

El entrenamiento está dirigido a estudiantes y profesionales de diferentes áreas del conocimiento, interesados en conocer y aplicar las principales herramientas analíticas para el análisis cuantitativo de riesgos.

Objetivo

Entender y aplicar de manera eficiente las principales herramientas analíticas para el análisis de riesgo con el apoyo de software especializado.

Temario

1. Introducción al análisis de Riesgo.

- ¿Por qué es importante la cuantificación de Riesgos?
- Tipos de riesgos.
- Herramientas analíticas para el análisis cuantitativo de Riesgos.
- Modelos Estáticos vs Modelos Probabilísticos.

2. Generación de escenarios probabilísticos a partir de la Simulación de Monte Carlo.

- Análisis clásico y moderno de modelos financieros.
- Identificación de variables relevantes en modelos financieros.
- Generación de números aleatorios.
- Definición y aplicación de las principales distribuciones de probabilidad.
- Interpretación estadística de Resultados.
- Análisis de Sensibilidad Dinámico y generación de escenarios.
- ROV BizStats: ajustes de distribución de probabilidad.

3. Optimización bajo incertidumbre.

- Introducción a la optimización lineal con Microsoft Excel y Solver.
- Aplicación de la optimización con variable de decisión binaria.
- Aplicación de la optimización continua en portafolios de inversión.
- Generación de la frontera eficiente.
- Optimización estática, dinámica y estocástica.

4. Predicción y pronóstico.

- a. Principales técnicas de pronóstico y estadísticas de error.
- b. Definición de series de tiempo y procesos estocásticos.
- c. Componentes de las series de tiempo.
- d. Técnicas de suavizamiento y generación de intervalos de pronóstico.
- e. Modelos ARIMA(p,d,q).
- f. Técnicas de pronóstico para la volatilidad: EWMA y GARCH(p,q).
- g. Procesos Estocásticos: Movimiento Geométrico Browniano.
- h. Análisis de Regresión lineal simple y múltiple.
- i. Análisis de Regresión no lineal: Probit y Logit.
- j. ROV BizStats: Regresión Lineal y no lineal.

5. Árboles de Decisión.

- a. ¿Qué es un árbol de decisión?
- b. Elementos de un árbol de decisión.
- c. Valor Monetario Esperado.
- d. Análisis dinámico de un árbol de decisión.
- e. Análisis de sensibilidad y escenarios.

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

Información General

Duración

24 horas

Fecha de Inicio

Lun. 27 de Ago de 2018

Horarios

Hora por país:

4:00 Pm San José de Costa Rica

5:00 pm CDMX - Bogotá - Quito - Lima

6:00 p.m La Paz - Caracas

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

3 horas por sesión.

Fechas:

Agosto 27 a Septiembre 6 de 2018



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