Entrenamiento Especializado

Fundamentación en Gestión Cuantitativa de Riesgo

Descripción

En este entrenamiento se abordará desde un enfoque sencillo y práctico las diferentes metodologías para cuantificar el riesgo, ofreciendo al participante herramientas que le permitirán complementar los conocimientos en la administración, cuantificación y gestión del riesgo.
 Al final del entrenamiento usted contará con información suficiente para solucionar casos habituales como: Modelado del riesgo a partir de distribuciones de probabilidad.
Evaluar decisiones de inversión a partir del VAN y la TIR bajo incertidumbre.
Optimizar decisiones de inversión de proyectos y portafolios.
Realizar pronósticos de variables inciertas.
Utilizar las opciones reales como alternativa de valoración de proyectos.

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 Integral de Riesgos.

Objetivo

- Aplicar métodos cuantitativos en el marco de la Gestión Integral de Riesgos con el apoyo de software especializado.

Temario

I. 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).

II. Conceptos de estadística para la cuantificación de riesgos

- Medidas de tendencia central.
- Medidas de dispersión o variabilidad.
- Medidas de distribución y ubicación.
- Medidas de asociación lineal y no lineal.
- Introducción a la probabilidad.
- Distribuciones de probabilidad.
- Intervalos de confianza y probabilidad.
- Pruebas de hipótesis.

III. Modelado de situaciones para la toma de decisiones y la gestión cuantitativa de riesgos

- Análisis de Punto único.
- Análisis de Sensibilidad Estático: análisis tornado y gráfico araña.
- Análisis de Simulación de Monte Carlo.
- Análisis de Sensibilidad Dinámico.
- Análisis de Escenarios.

IV. Tipos de optimización para la diversificación de riesgo

- Búsqueda de objetivo.
- Optimización Estática.
- Optimización Dinámica.
- Optimización Estocástica.

V. Aplicación de las técnicas de pronóstico en la toma de decisiones.

- 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.

VI. 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 del precio de la opción: Black-Scholes, Simulación de Monte Carlo, Árboles Binomiales.

Instructores

Miguel Ángel Bello Bernal, Mag.

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
Mar. 21 de Ago de 2018

Horarios
Fechas:
De Agosto 21 a Septiembre 6 de 2018

Lunes a Jueves
Duración sesiones: 2 horas y 30 minutos

Hora por país:
17:00 San José de Costa Rica
18:00 Bogotá - Lima - Quito - CDMX
19:00 La Paz - Santiago de Chile - Caracas
20:00 Buenos Aires

Herramientas de apoyo



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