Certificación

Certificación Internacional en Administración de Riesgo Cuantitativo. CQRM Virtual Quito

Descripción

Ventajas claves de atender este seminario:
 -Obtener la Certificación Internacional como Administración de Riesgo (CRM-IIPER).
 -Aprender de un verdadero experto mundial en el campo, con las mejores credenciales y experiencia práctica.
 -Obtenerlo directamente de la fuente original. El instructor del Seminario, es Doctor en finanzas y economía; es consultor de más de 100 multinacionales y es conocido mundialmente por su expertis y experiencia en análisis de riesgo y Opciones Reales.
 -Se brinda por medio de este curso un acercamiento básico pero profundo a los planteamientos teóricos necesarios con los que se debe contar para la administración del riesgo; además, la fusión entre Risk Simulator y Excel da la posibilidad para cualquier usuario de poder interactuar con el software sin mayores complicaciones.
 -Aprenderá a manejar una herramienta capaz de analizar grandes volúmenes de información y que además cuenta con los mejores métodos teóricos para poder estar en la vanguardia tanto técnica como teórica. En la herramienta Risk Simulator encontramos la vinculación perfecta entre máquina y teoría.
 -No es necesario contar con conocimientos demasiado avanzados, ni niveles de estudio altos para poder participar en el seminario CQRM, ya que se brinda por medio de este curso, un acercamiento básico pero profundo a los planteamientos teóricos necesarios con los que se debe contar para la administración del Riesgo; además, la fusión entre Risk Simulator y Excel da la posibilidad para cualquier usuario de poder interactuar con el software sin mayores complicaciones.
 -Aplicabilidad de conocimientos en áreas como: Hidrocarburos, construcción, hidroeléctricas, sector financiero, Gobierno, aseguradoras, academia, investigación, entre otras.
 -A través de este CQRM, el participante podrá realizar análisis profundos para comprender el pasado, el presente y pronosticar el futuro.
 -Podrá obtener mejores resultados en los negocios, ya que aprenderá a tomar decisiones en momentos de incertidumbre. -Obtener documentación amplia sobre los temas de administración de riesgo que se tratan en el Seminario.

Dirigido a

Directivos y Analistas Financieros, de Tesorerías, Crédito, Liquidez, Mercados, Operaciones, Evaluación de Proyectos, Costos, Presupuestos, Producción, Compras, Planeación, etc., en sectores como: Energía, Hidrocarburos, Gas, Minería, Acueductos, Química, Medio ambiente, Defensa, Transporte, Banca, Seguros, Servicios financieros, Infraestructura, Ingeniería, Manufactura, Comercial al por mayor y al Detal, Ganadería, Alimentos, Construcción, Turismo, Aviación, etc. También a Profesores y estudiantes de posgrados interesados en estas áreas.

Objetivo

Después de atender la certificación los participantes analizarán, desarrollarán, sabrán leer los datos para la Medición de Riesgo, entenderán los resultados arrojados por los modelos y podrán sugerir y tomar decisiones basados en la Optimización y Opciones Reales aplicables a sus proyectos.

Aprenderán las bases teóricas y las aplicaciones prácticas en el análisis de Riesgo. En tan solo cuatro días, el Dr. Mun convierte a un asistente sin conocimientos demasiado avanzados en riesgo en un **Profesional Experto Certificado en Administración de Riesgo**, con un altísimo nivel de conocimiento, para tomar decisiones críticas en momentos de incertidumbre.

Tras la finalización del seminario y de la realización y aprobación de una prueba escrita de respuestas múltiples administrada el último día, a los participantes se les otorgará la Certificación Internacional en Administración del Riesgo CQRM.

Temario

MÓDULO 1: Introducción al Análisis de Riesgo

Capítulo 1: Introducción al Entrenamiento
Capítulo 2: Como se hacen las decisiones en los negocios?
Capítulo 3: Que es Riesgo/Porqué hay que considerarlo?
Capítulo 4: Vista general de Aplicaciones Software de Análisis de Riesgo

MÓDULO 2: Simulación Monte Carlo con Risk Simulator

Capítulo 1: Vista General de Risk Simulator Software
Capítulo 2: Perfiles, Supuestos, Pronósticos y Simulaciones
Capítulo 3: Interpretación de las Estadísticas de Pronósticos
Capítulo 4: Preferencias de Simulación y Valores Semilla
Capítulo 5: Ejecución de Reportes, Guardar Archivos y Extracción de Datos de la Simulación

MÓDULO 3: Técnicas Avanzadas de Simulación

Capítulo 1: Correlacionar y Truncar la Distribución
Capítulo 2: Alternar Parámetros
Capítulo 3: Simulaciones Multidimensionales
Capítulo 4: Ajuste de Distribuciones
Capítulo 5: Debida Diligencia y Errores en la Simulación

MÓDULO 4: Herramientas Analíticas y de Simulación

Capítulo 1: Análisis Tornado y Graficas Araña
Capítulo 2: Análisis de Sensibilidad Dinámica
Capítulo 3: Prueba de Hipótesis para Diferentes Distribuciones
Capítulo 4: Simulación Bootstrap No-Paramétrica

MÓDULO 5: Optimización con Risk Simulator

Capítulo 1: Introducción a la Optimización
Capítulo 2: Optimización Continua
Capítulo 3: Optimización Entera

MÓDULO 6: Pronósticos

Capítulo 1: Técnicas de Pronósticos y Tipos de Datos
Capítulo 2: Pronósticos sin Datos
Capítulo 3: Análisis de Pronósticos de Series de Tiempo
Capítulo 4: Extrapolación No Lineal
Capítulo 5: Análisis de Regresión Multivariado
Capítulo 6: Procesos Estocásticos
Capítulo 7: Box-Jenkins ARIMA

MÓDULO 7: Análisis de Opciones Reales: Teoría y Entorno
Capítulo 1: Introducción a Opciones Reales: Qué, Donde, Quién, Cuándo, Cómo y Porqué?
Capítulo 2: Ejemplos de Casos de Negocios Aplicados
Capítulo 3: Vista General de Diferentes Técnicas de Valoración de Opciones: Comparación entre opciones financieras y reales Capítulo 4: Técnica de Probabilidad Neutral al Riesgo
Capítulo 5: Opciones European y American Call
Capítulo 6: Utilizar Microsoft Excel Para solucionar una opción European y American Call
Capítulo 7: Solución de opciones básicas de Abandono, Expansión, Contracción y Alternativas

MODULE 8: Análisis de Opciones Reales: Aplicación de SLS Software

Capítulo 1: Vista General de Módulos SLS y Estimación de la Volatilidad
Capítulo 2: Estimación de la Volatilidad
Capítulo 3: Solución de Opciones con Entradas Cambiantes y Opciones Exóticas Personalizadas
Capítulo 4: MSLS: Múltiples opciones compuestas secuenciales
Capítulo 5: MNLS: Solución de Reversión a la Media, Difusión de Salto y Opción Arcoíris sobre Activos Duales utilizando Arboles Trinomiales, Tetranomiales y Pentanomiales
Capítulo 6: Enmarcar Opciones Reales

Instructores

Dr. Johnathan Mun - Ph.D., MS, MBA, BS, CRM, FRM, CFC, MIFC
Fundador y CEO de Real Options Valuation Inc, empresa global de consultoría, entrenamiento y desarrollo de software especializado en análisis avanzado de Gestión de Riesgo, Opciones Reales y Valoración Financiera, con presencia en más de 30 países. Como desarrollador del software, cuenta con más de 12 patentes, 10,000 páginas de material registrado y más de 20 libros escritos. Ha impartido seminarios a nivel mundial, es docente en el U.S. Naval Postgraduate School (Escuela de Postgrado Naval), en la Universidad de Ciencias Aplicadas en Zurich, Suiza, y ha colaborado en múltiples universidades entre ellas la Universidad Estatal de San Francisco y la Universidad de Santa Clara en California. Es consultor para empresas Fortune 500, entre ellas 3M, Airbus, Boeing, GE, Motorola, así como para el gobierno de los Estados Unidos, incluyendo el Departamento de Defensa y agencias federales.

Información General

Duración
32 horas

Fecha de Inicio

Mar. 24 de Sep de 2019

Horarios

Septiembre 24, 25 y 26 de 2019
Preparación
De 8:00 a.m. a 6:00 p.m.

Examen
Septiembre 27 de 2019
De 8:00 a.m. a 10:00 a.m.

Conferencias en Métodos Cuantitativos
11:00 am

Ciudad

Quito (Pichincha, Ecuador)

Lugar:

SOFTWARE shop Quito

Herramientas de apoyo

Mayores informes de inscripción y costos

Entrenamientos@Software-Shop.com

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