

# Entrenamiento Especializado

## Entrenamiento online: 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, Magíster en Administración y Dirección de Empresas de la Universidad Villanueva en Madrid-España y acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgo - CQRM, impartida por el Dr. Johnathan Mun y otorgada por el Instituto IIPER. Actualmente, es consultor y docente en el Colegio de Estudios Superiores de Administración (CESA) , además, se ha desempeñado como docente y director de tesis de maestría en diferentes universidades de la región así como expositor internacional e instructor especializado en temas de riesgo y finanzas como parte del equipo de instructores de Software Shop para Latinoamérica.

## Información General

### Duración

20 horas

### Fecha de Inicio

Lun. 22 de Oct de 2018

### Horarios

Fechas:

Octubre 22, 23, 24, 25, 26 y 27 de 2018

De:

5:30 pm a 8:30 pm - (3 horas por sesión)

Hora por país:

4:30 p.m San José de Costa Rica

5:30 pm CDMX - Bogotá - Quito - Lima - Caracas

6:30 p.m La Paz

7:30 p.m Buenos Aires - Santiago de Chile



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