Entrenamiento Especializado

Entrenamiento online: Fundamentación en Gestión Cuantitativa de Riesgo.

Descripción

En este entrenamiento especializado se abordarán, desde un enfoque sencillo y práctico, los diferentes métodos para cuantificar el riesgo, ofreciendo a los participantes herramientas prácticas que les permitirán complementar y ampliar sus conocimientos en los procesos de administración, cuantificación, gestión del riesgo y toma de decisiones. Al finalizar este entrenamiento, los participantes contarán 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

Dirigido a Vicepresidentes, Gerentes y Analistas de todos los sectores económicos interesados en conocer los conceptos y aplicaciones de los métodos cuantitativos para el análisis de riesgo.

Objetivo

Implementar los principales Métodos Cuantitativos dentro del marco de la Gestión Integral de Riesgos.

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 Cuantificación de Riesgos.

- Medidas de Tendencia Central y Posición.
- Medidas de Dispersión o Variabilidad.
- Medidas de Forma.
- Medidas de Asociación Lineal y No lineal.
- Introducción a la Probabilidad.
- Principales Distribuciones de Probabilidad y su Aplicación.
- Intervalos de Confianza y Probabilidad.
- 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 Tornado y Gráfico Araña.
- Análisis de Simulación de Monte Carlo.
- Análisis de Sensibilidad Dinámico.
- Análisis de Escenarios.
-

Tipos de Optimización para la Diversificación de Riesgo.

- Búsqueda de Objetivo.
- Optimización Estática.
- Optimización Dinámica.
- Optimización Estocástica.
- Generación de la Frontera Eficiente.
-

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.

- Procesos Estocásticos.
- Modelo de Regresión Lineal Simple y Múltiple.
- Modelo de Regresión Logística.
- Modelos de Volatilidad.
-

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

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

18 horas

Fecha de Inicio

Mar. 10 de Sep de 2019

Horarios

4:30 Pm San José de Costa Rica
5:30 pm CDMX - Bogotá - Quito - Lima
6:30 p.m La Paz - Caracas - Santiago de Chile
7:30 p.m Buenos Aires

Herramientas de apoyo

CONVENCIÓN LATINOAMERICANA
EN MÉTODOS CUANTITATIVOS Y GESTIÓN DE RIESGO

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