Entrenamiento Especializado

Análisis Estadístico en la Cuantificación de Riesgos Financieros y en Proyectos.

Descripción

 <span style="font-size:10pt;font-family:Arial;color:#000000;background-color:transparent;font-weight:400;font-style:normal;font-variant:normal;text-decoration:none;vertical-align:baseline;white-space:pre;white-space:pre-wrap;">En este entrenamiento se abordarán de forma teórico - práctica las diferentes metodologías para la cuantificación de riesgo aplicado al sector financiero y a la gestión de proyectos, ofreciendo al participante herramientas que le permitirán apropiar y complementar conocimientos en formulación, administración, cuantificación y gestión del riesgo aplicando métodos cuantitativos. El curso iniciará con los componentes teóricos y prácticos comunes y avanzará hacia la el abordaje de casos aplicados. <span style="font-size:10pt;font-family:Arial;color:#000000;background-color:transparent;font-weight:400;font-style:normal;font-variant:normal;text-decoration:none;vertical-align:baseline;white-space:pre;white-space:pre-wrap;"> Los participantes contarán con tres módulos de profundización que podrán seleccionar de acuerdo a sus intereses: Riesgo de Mercado, Riesgo de Crédito o Riesgo en Proyectos.

Dirigido a

Gerentes financieros y de riesgos, directores, coordinadores de proyectos, analistas financieros, consultores, docentes, investigadores, estudiantes de disciplinas financieras, económicas e ingenierías y en general todas aquellas personas interesadas en profundizar conceptos, aplicaciones y metodologías para cuantificar riesgos financieros con el apoyo de la simulación de Monte Carlo y otros procedimientos cuantitativos utilizando herramientas especializadas.

Objetivo

- Conocer los principales conceptos y procedimientos relacionados con el análisis cuantitativo de Riesgo, incluyendo los fundamentos estadísticos requeridos para su comprensión y aplicación.
- Aplicar, mediante el apoyo de herramientas especializadas, métodos cuantitativos para el análisis y valoración de Riesgos Financieros, profundizando en Riesgo de Mercado y Riesgo de Crédito.
- Aplicar, mediante el apoyo de herramientas especializadas, métodos cuantitativos para el modelado de situaciones para la toma de decisiones y la gestión cuantitativa de Riesgo en Proyectos.

Temario

Módulo transversal - 8 horas

Módulo I: 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.
- Distribución de frecuencias y probabilidad.
- Ley de los grandes números, teorema del límite central, intervalos de confianza y probabilidad.
- Principales distribuciones de probabilidad: Bernoulli, Binomial, Poisson, Normal, Triangular, PERT, Uniforme, Log Normal.

Módulos de aplicación: Electivos de acuerdo al interés del participante

Módulo II: Cuantificación de Riesgo de Mercado - Electivo

4 horas

- Metodologías en la medición del riesgo de mercado.

Paramétrico.
Simulación histórica.
Simulación de Monte Carlo.

- Backtesting:

Cociente de Fallas.
Proporción log probabilística y test de kupiec.
Verificación y calibración.

- Críticas al VaR y metodología alternativa, CVaR.
- Optimización de portafolios de inversión de manera estocástica.
- Stresstesting.

Módulo III: Cuantificación de Riesgo de Crédito - Electivo

4 horas

- Matrices de transición para el cálculo de la probabilidad de incumplimiento.
- Modelos de regresión no lineal: Logit y Probit.

Estimación de coeficientes.
Interpretación de coeficientes.
Validación del modelo a partir de tablas de clasificación.
Pronóstico.
Cálculo de la pérdida esperada y no esperada con simulación de Monte Carlo.

- Análisis discriminante de dos grupos.
- Segmentación de grupos.

Modulo IV:

Modelado de Situaciones para la Toma de Decisiones y la Gestión Cuantitativa de Riesgos en Proyectos - Electivo
8 Horas

- 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.
- Técnicas de estimación de volatilidad.

Coeficiente de variación, VaR y probabilidad.
Aproximación del logaritmo de los flujos de caja.
Volatilidad de precios: desviación estándar, EWMA y GARCH.
Supuestos de gestión y método Delphi.

- Optimización en la selección de proyectos de inversión.

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

24 horas

Fecha de Inicio

Mie. 24 de Jul de 2019

Horarios

Fecha:

Julio 24, 25 y 26 de 2019.

Horario:

9:00 a.m. a 6:00 p.m.

Ciudad

Quito (Pichincha, Ecuador)

Lugar:

SOFTWARE shop Quito

Herramientas de apoyo

Risk Simulator

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