

# Entrenamiento Especializado

## CRM - CERTIFIED IN RISK MANAGEMENT

### 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 Árboles 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. 01 de Ene de 2008

## Horarios

9:00 a.m. a 5:00 p.m.

## Ciudad

Santiago de Chile (Metropolitana, Chile)

## Lugar:

SOFTWARE shop

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