

Entrenamiento Especializado

Entrenamiento Especializado Fundamentación en Administración de Riesgo, con el Apoyo de Risk Simulator - Santiago de Chile

Descripción

El seminario aborda desde un enfoque sencillo y práctico los diferentes tipos de riesgo dando al estudiante herramientas que le permitirán trabajar en el mundo del manejo del riesgo, incluyendo el tema de Opciones Reales que es un tópico útil en la toma de decisiones en ambientes de negocios bajo incertidumbre, dinámicos, flexibles o cambiantes. Los asistentes podrán interactuar con el software Risk Simulator que les permitirá cuantificar el riesgo y les servirá de herramienta para la toma de decisiones, así como con el software Real Options SLS que le permitirá analizar y valorar Opciones Reales, Opciones Financieras, Opciones Exóticas y Stock Options para incorporarlas dentro y a la medida de los modelos de hojas de cálculo. Al completar este curso, los participantes habrán sido expuestos a los conceptos y las técnicas que son prerequisites necesarios para llevar a cabo un análisis de riesgo y para tomar decisiones acertadas, utilizando como herramientas el software de Risk Simulator y Real Options SLS.

Dirigido a

Este curso está dirigido a personas con conocimientos básicos en riesgo e interesadas en la Gestión, Control y Administración de Riesgo, que deseen cubrir el marco teórico del área sin exponerse de una manera extensa a los detalles de complicados modelos matemáticos, pero obteniendo avanzados resultados en términos estadísticos y financieros.

Objetivo

El objetivo primordial es llevar al asistente por las principales metodologías teóricas desde un enfoque práctico, para que pueda tener una contextualización en el manejo, modelación, medición y administración del riesgo, usando además herramientas estadísticas que soporten la toma de decisiones y le permitan realizar una mejor Gestión del Riesgo.

Temario

Conceptualización de la Teoría y administración del Riesgo Introducción a la Simulación Introducción a la Optimización Análisis y Presentación de Resultados para la toma de decisiones 1. Gráficas de pronósticos 2. Gráficas de Sensibilidad 3. Gráficas de Tendencia 4. Generación de reportes personalizados 5. Extracción de resultados 6. Guardando los resultados Toma de decisiones a partir de Pronósticos 1. Introducción al pronóstico 2. Introducción a la econometría * ¿Qué es regresión? * ¿Qué son los modelos de series de tiempo? * Modelos de volatilidad 3. Ejercicios de pronósticos con Risk Simulator * Regresión * ARIMA * GARCH * Otros tópicos Análisis de Riesgo de Mercado 1. Cálculo del VaR 2. Modelo de Portafolio de Acciones 3. Modelo de Optimización Estocástica Análisis de Riesgo de Crédito Introducción a Opciones Reales con Real Options SLS 1. ¿Qué son opciones reales? 2. ¿Por qué usar opciones reales? 3. ¿Quién utiliza opciones reales? 4. Un ejemplo de opciones reales 5. Enfoque clásico de valoración de proyectos Vs. Opciones reales 6. Opciones Reales Vs. Opciones Financieras 7. Tipos de Opciones reales : diferir, abandonar, expandir, contraer 8. Risk Simulator y las Opciones reales 9. Valoración con Opciones reales 10.

Ejemplos prácticos de Opciones reales con Risk Simulator Ejercicio final (Análisis de sensibilidad, pronósticos y Opciones Reales)

Instructores

Brayan Ricardo Rojas Ormaza, Mag.

Economista, con especialización en gestión de riesgos financieros y maestría en finanzas. Cuenta con más de 10 años de experiencia en la industria bancaria, financiera y de consultoría. Actualmente, es el Director de Riesgos Financieros en KPMG Colombia, en donde lidera procesos de implementación de gestión de riesgos, analítica de datos y machine learning en diferentes sectores e industrias para entidades públicas y privadas. Es profesor de cursos de posgrado en diferentes instituciones como la Universidad del Rosario, EAFIT y el Politécnico Grancolombiano. Además, hace parte del equipo de instructores del área cuantitativa de Software Shop, en donde trabaja con diferentes herramientas para el análisis estadístico y econométrico.

Información General

Duración

16 horas

Fecha de Inicio

Mie. 26 de May de 2010

Horarios

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

Ciudad

Santiago de Chile (Metropolitana, Chile)

Lugar:

SOFTWARE shop - Santiago de Chile

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