



Entrenamiento Presencial: Medición de Riesgos Financieros con el apoyo de la Simulación de Monte Carlo

Lima, Perú • Del 15 al 19 de Octubre de 2018

Dirigido a:

Gerentes de Riesgos y Finanzas, Analistas Financieros, Consultores, Docentes, Investigadores, Estudiantes de disciplinas Financieras, Económicas e Ingenierías y en general todas aquellas personas interesadas en conocer los conceptos, aplicaciones y metodologías para la Cuantificación de Riesgos Financieros con el apoyo de la Simulación de Monte Carlo.

Objetivos:

- Ofrecer al participante los Conceptos y Herramientas necesarias para la Cuantificación de Riesgos Financieros.

Descripción:

En este entrenamiento se abordarán, desde un enfoque sencillo y práctico, los diferentes tipos de riesgo ofreciendo al participante herramientas analíticas especializadas que le permitirán complementar el Análisis, Administración y Gestión de Riesgos Financieros.

Al finalizar este entrenamiento el participante manejará los conceptos y técnicas necesarias para llevar a cabo un análisis de riesgo apoyado de la Simulación de Monte Carlo para la posterior Toma de Decisiones.

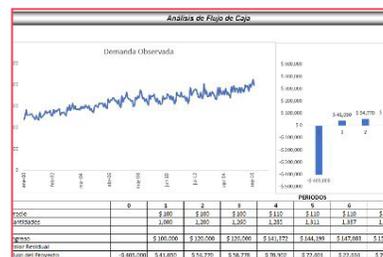


TEMARIO

Módulo I: Introducción al Riesgo y Aplicación en Software

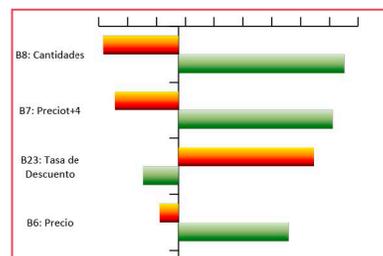
El concepto de Riesgo: ¿Qué es y por qué nos interesa conocerlo?

- 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.
- 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.
- Pruebas de Hipótesis.



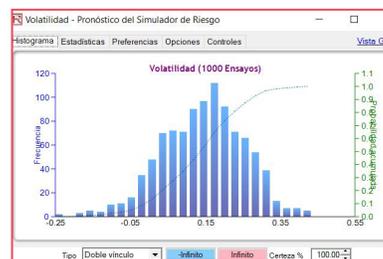
Modelado de situaciones para la Toma de Decisiones y la Gestión Cuantitativa de Riesgos

- 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.

Módulo II: Cuantificación de Riesgos Financieros

Estimación de Volatilidad en Proyectos de Inversión

- 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.



INSTRUCTOR

**Mag. Miguel Ángel Bello Bernal**

Economista de la Universidad de la Salle de Colombia, con Maestría en Administración y Dirección de Empresas de la Universidad Villanueva en Madrid - España y una Certificación Internacional en Gestión Cuantitativa de Riesgo Cuantitativos (CQRM) otorgada por el instituto iiPER(International Institute of Professional Education and Research).

Instructor del Portafolio de Riesgo de Software Shop para Latinoamérica, se ha desempeñado como docente de Estadística, Toma de Decisiones y Econometría Financiera en Especialización y Maestría en diferentes universidades de Colombia.

Lugar:

Universidad del Pacífico.

Jr. Sánchez Cerro 2098 - Jesús María.

Aula J-603.

Lima - Perú.

Fecha

Del 15 al 19 de Octubre de 2018

Horario

De 14:00 a 18:00

Duración

20 Horas

Mayores Informes y Costos**José Luis Florián**

Joseluis@Software-Shop.com

Tel: +51-1-706-8197 **Ext:** 101 - 201

WhatsApp: +57-304-545-2724

Skype: joseluis.florian

Apoya:



Pacífico
Business School