



Entrenamiento Presencial: Análisis Estadístico en la Cuantificación de Riesgos Financieros y en Proyectos

Quito - Ecuador, Julio 24, 25 y 26 de 2019

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 Microsoft Excel®.

Objetivos:

- Conocer los principales Fundamentos Estadísticos para el Modelado Financiero bajo Incertidumbre.
- Aplicar Métodos Cuantitativos para el Análisis Financiero y Valoración de Riesgos Financieros y en Proyectos.
- Proporcionar a los participantes el proceso del Análisis Integrado de Riesgos a través del uso de Herramientas Especializadas como Microsoft Excel® y Risk Simulator.

Descripción:

En este entrenamiento se abordará desde un enfoque sencillo y práctico las diferentes Metodologías para la Cuantificación de Riesgos Financieros y en Proyectos, ofreciendo al participante herramientas que le permitirán complementar los conocimientos en la Formulación, Administración, Cuantificación y Gestión del Riesgo aplicando Métodos de Investigación Cuantitativa.

A partir de Plantillas de Microsoft Excel y con el apoyo de Risk Simulator se abarcarán los componentes teóricos y básicos de valoración para luego trabajar casos más complejos con el apoyo de Risk Simulator, software especializado de Simulación de Monte Carlo.

Importante:

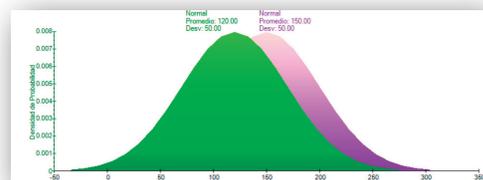
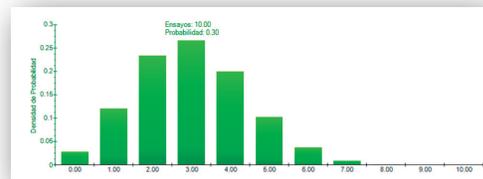
Los participantes podrán optar por el Entrenamiento de forma completa u optar por la participación de algún Módulo en particular teniendo en cuenta que el **Módulo I de Conceptos de Estadística es Obligatorio**.

TEMARIO

Modulo I:

Conceptos de Estadística para la Cuantificación de Riesgos (8 Horas - Sesión Obligatoria)

- 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.



Modulo II:

Cuantificación de Riesgo de Mercado (4 Horas)

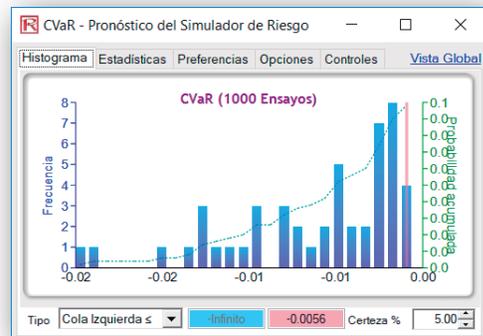
- Metodologías en la Medición del Riesgo de Mercado.
 - Paramétrico.
 - Simulación Histórica.
 - Simulación de Monte Carlo.
- Backtesting:
 - Cociente de Fallas.
 - Proporción log-Probabilística y Test de Kupiec.
 - Verificación y Calibración.
- Críticas al VaR y Metodología Alternativa, CVaR.
- Optimización de Portafolios de Inversión de manera Estocástica.
- Stresstesting.



Modulo III:

Cuantificación de Riesgo de Crédito (4 Horas)

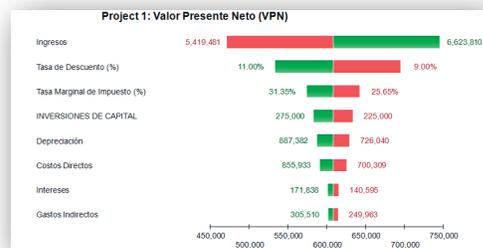
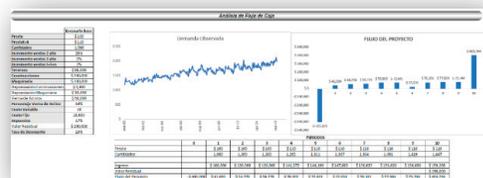
- Matrices de Transición para el cálculo de la Probabilidad de Incumplimiento.
- Modelos de Regresión No Lineal: Logit y Probit.
 - Estimación de Coeficientes.
 - Interpretación de Coeficientes.
 - Validación del Modelo a partir de Tablas de Clasificación.
 - Pronóstico.
 - Cálculo de la Pérdida Esperada y No Esperada con Simulación de Monte Carlo.
- Análisis Discriminante de Dos Grupos.
- Segmentación de Grupos.



Modulo Modulo IV:

Modelado de Situaciones para la Toma de Decisiones y la Gestión Cuantitativa de Riesgos en Proyectos (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.



INSTRUCTOR



Miguel Ángel Bello Bernal, Mag.

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 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.

Duración Total:

24 Horas

Fecha:

Julio 24, 25 y 26 de 2019

Horario:

De 9:00 Am a 6:00 Pm.

Mayores Informes y Costos

José Luis Florián

Joseluis@Software-Shop.com

WhatsApp: +57-304-545-2724