



Entrenamiento Presencial: Fundamentación en Gestión Cuantitativa de Riesgo

Mayo 6 al 9 de 2019

Dirigido a:

Gerentes Financieros y de Riesgos, Analistas Financieros, Consultores, Docentes, Investigadores, Estudiantes de disciplinas financieras, económicas e ingenierías y en general todas aquellas personas interesadas en conocer los Conceptos y Aplicaciones de los Métodos Cuantitativos para el Análisis de Riesgos.

Objetivo:

Implementar los principales Métodos Cuantitativos dentro del marco de la Gestión Integral de Riesgos.

Descripción:

En este entrenamiento se abordará desde un enfoque sencillo y práctico los diferentes métodos para cuantificar el riesgo; ofreciendo a los participantes herramientas que le permitirán complementar los conocimientos en la Administración, Cuantificación y Gestión del Riesgo.

Al final del entrenamiento los participantes contarán con información suficiente para solucionar casos habituales como:

- Modelado del Riesgo a partir de Distribuciones de Probabilidad.
- Evaluar Decisiones de Inversión a partir del VAN y la TIR bajo Incertidumbre.
- Optimizar Decisiones de Inversión de Proyectos y Portafolios.
- Realizar Pronósticos de variables inciertas.
- Utilizar las Opciones Reales como alternativa de Valoración de Proyectos.

TEMARIO

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

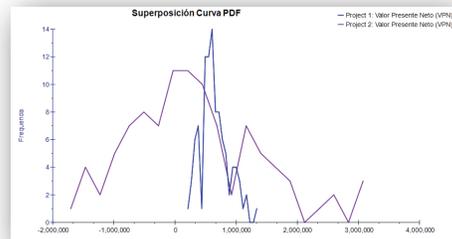
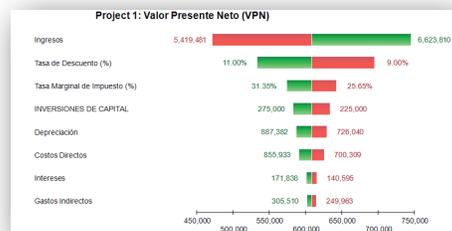
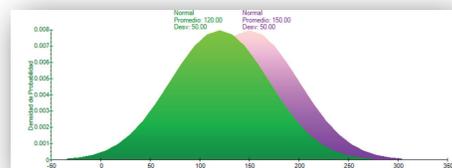
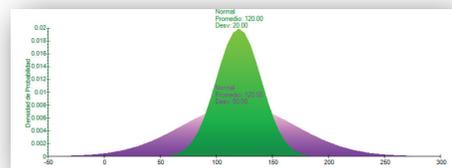
- Medidas de Tendencia Central y Posición.
- Medidas de Dispersión o Variabilidad.
- Medidas de Forma.
- Medidas de Asociación Lineal y No lineal.
- Introducción a la Probabilidad.
- Principales Distribuciones de Probabilidad y su Aplicación.
- Intervalos de Confianza y Probabilidad.
- Pruebas de Hipótesis.

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.

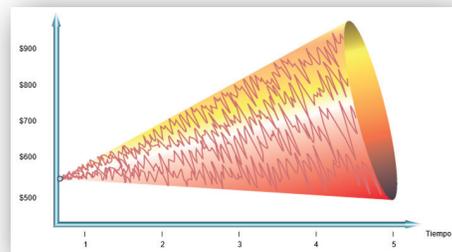
Tipos de Optimización para la Diversificación de Riesgo

- Búsqueda de Objetivo.
- Optimización Estática.
- Optimización Dinámica.
- Optimización Estocástica.
- Generación de la Frontera Eficiente.



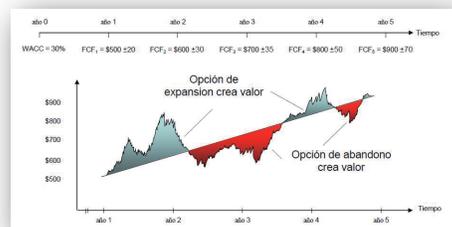
Aplicación de las Técnicas de Pronóstico en la Toma de Decisiones

- Componentes y Patrones de una Serie de Tiempo.
- Desestacionalizar una Serie de Tiempo.
- Técnicas de Suavizamiento.
- Metodología Box-Jenkins.
- Procesos Estocásticos.
- Modelo de Regresión Lineal Simple y Múltiple.
- Modelo de Regresión Logística.
- Modelos de Volatilidad.



Opciones Reales: Alternativa para la Valoración de Proyectos de Inversión

- ¿Qué son las Opciones Reales?
- Comparación entre Opciones Financieras y Reales.
- Variables que determinan el precio de una Opción Real.
- Metodologías para el cálculo del precio de la Opción.
 - Black-Scholes.
 - Simulación de Monte Carlo.
 - Árboles Binomiales.



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:
16 Horas

Fecha:
De Mayo 6 al 9 de 2019

Horario:
De 1:00 Pm a 5:00 Pm.

Lugar:



Pacífico
Business School

Jr. Sánchez Cerro 2121 - Jesús María.
Laboratorio J-603

Mayores Informes y Costos
José Luis Florián

Sector Corporativo

Joseluis@Software-Shop.com

Tel. +51 (1) 706 8197 Ext. 101 - 201

WhatsApp: +57-304-545-2724