

Entrenamiento Especializado

Introducción a la Gestión Integral de Riesgos con el apoyo de Risk Simulator

Descripción

La gestión cuantitativa de riesgos es una habilidad fundamental para que las organizaciones puedan garantizar su estabilidad y maximizar sus oportunidades de éxito. Este curso está diseñado para proporcionar a los asistentes las herramientas necesarias para identificar, evaluar y gestionar eficazmente riesgos a partir de casos prácticos con el apoyo de Risk Simulator, una herramienta especializada que permite potenciar estos análisis trabajando directamente desde Excel.

Dirigido a

Profesionales, analistas y docentes de economía, finanzas, contabilidad, ingeniería, administración y áreas afines así como público en general, interesado en desarrollar las habilidades necesarias para la elaboración de modelos cuantitativos que les permita apoyar la toma de decisiones bajo escenarios de incertidumbre.

Nota: Este curso se ofrece para inscripción abierta en las fechas indicadas o para grupos institucionales con fechas acordadas. Para más información sobre la oferta de este curso para grupos, escríbanos a los datos de contacto que encontrará al final de la página.

Objetivo

- Presentar a los participantes las posibilidades que brinda Risk Simulator para la gestión cuantitativa de riesgos.
- Proporcionar herramientas básicas para el análisis de datos económicos y financieros, aplicando el método de simulación de Montecarlo en la resolución de problemas.

Temario

Conceptos estadísticos previos

- Estadística descriptiva.
- Momentos de una distribución.
- Pruebas de hipótesis.

Introducción a Risk Simulator como herramienta especializada

- Creación de perfil de trabajo.
- Definición de celdas de entrada.
- Definición de celdas pronóstico.
- Definición de variables objetivo.

Análisis de sensibilidad

- Modelamiento financiero.
- Análisis de Tornado.

- Simulación de Montecarlo
- Análisis de escenarios.
- Ventajas del uso de Risk Simulator para análisis de sensibilidad.

Optimización de Portafolios de Inversión

- Rentabilidad y retorno.
- Optimización estática.
- Optimización dinámica.
- Ventajas del uso de Risk Simulator para Optimización.

Pronósticos

- Definiciones.
- Componentes y patrones de una serie de tiempo.
- Técnicas de suavizamiento.
- ARIMA.
- Modelo de Regresión Lineal Simple y Múltiple.
- Modelo de Regresión Logística.

Reflexiones finales

- Importancia de la gestión cuantitativa de riesgos.
- Áreas de aplicación.
- Temáticas de profundización: Certificación Internacional CQRM.

Instructores

Erika Paola Laitón Castellanos

Profesional en Estadística de la Universidad Nacional de Colombia con experiencia en el uso, enseñanza e implementación de herramientas especializadas para el análisis de datos cuantitativos con aplicaciones a política pública, economía, educación y estudios sociales. Como gerente del portafolio cuantitativo en Software Shop apoya a grupos de investigación y entidades públicas y privadas de Latinoamérica en temas relacionados con gestión y análisis de grandes volúmenes de datos así como las posibilidades de integración de métodos cuantitativos y cualitativos.

Thomas Dávila Correa

Instructor de la línea de Riesgo y Finanzas en Software Shop con formación en economía de la Universidad Militar Nueva Granada, participante del grupo de estudios en educación, contabilidad y sociedad, con experiencia en el manejo de herramientas informáticas para el análisis de datos, su aprovechamiento y apoyo en la toma de decisiones.

Información General

Duración

15 horas

Fecha de Inicio

Lun. 25 de Nov de 2024

Horarios

Fechas:

Noviembre 25 y 27 y diciembre 2, 4 y 9 dl 2024

Hora de inicio por país:

3:00 p.m Costa Rica - México

4:00 pm Colombia - Ecuador- Perú

5:00 p.m Bolivia - Venezuela - Chile

6:00 p.m Brasil - Argentina



Políticas

Para conocer en detalle las condiciones y políticas de participación en los eventos, ingrese a nuestro link <https://software-shop.com/formacion/politicas>

Inscríbete ahora