



CURSO:

GESTIÓN DEL RIESGO: PORTAFOLIO DE ACTIVOS FINANCIEROS Y REALES



OBJETIVO

Frente a un entorno empresarial cada vez más dependiente de mercados globales, es necesario contar con herramientas que permitan gestionar la exposición al riesgo mediante la diversificación.

REQUISITOS

Conocimientos básicos de Finanzas y Estadística.

DURACIÓN

15 horas reloj

CERTIFICACIÓN

El certificado es otorgado por la Universidad Privada de Santa Cruz de la Sierra – UPSA

CONTENIDO MÍNIMO

Introducción a la Medición del Riesgo

- Caracterización de Riesgo de los Activos
- Diversificación del Riesgo

Teoría Clásica de Portafolio

- Minimizando el Riesgo
- Optimizando la relación rentabilidad vs. riesgo
- Emulando el mercado
- Portafolio No Paramétrico

Teoría de Portafolio con Aplicación Dinámica

- Introducción al Análisis de Riesgo
- Modelado y Optimización con Riesgo
- Aplicación a Portafolios

Portafolio de Activos Reales

- Introducción a Evaluación de Proyectos
- Definición de la Cartera de Proyectos (sin joint ventures)
- Definición de la Cartera de Proyectos (con joint ventures)

METODOLOGÍA

- Los encuentros serán de carácter predominantemente práctico, permitiendo el intercambio de criterios, opiniones y experiencias entre los participantes y el facilitador.
- Se contará con una plataforma virtual donde se distribuirá el material. Adicionalmente se contará con ejemplos y ejercicios en formato de hoja electrónica.
- Se entregará una plantilla electrónica[©] para la determinación de la compensación “justa” al riesgo asumido por los inversionistas de una empresa.
- Todos los encuentros se realizarán en laboratorios de cómputo, para el desarrollo de ejercicios asistidos por hojas electrónicas de MS Excel y software especializados. Si el participante desea traer su propio equipo es libre de hacerlo.

INSTRUCTOR

Juan Fernando Subirana

Candidato a Doctor en Economía y Finanzas en la UPB, Magíster en Ingeniería Financiera de la UPSA, Diplomado en Educación Superior, Diplomado en Gestión y Tecnología del Gas Natural e Ingeniero Comercial de la UPSA.

Participante del programa “International Visitor Leadership Program”, para la Seguridad Energética del Hemisferio Occidental, a través de la Embajada

de U.S.A. y Certificado Internacional en Administración y Análisis de Riesgo Avanzado (CRM) por el Instituto IPPER.

Docente en la UPSA en las áreas de Estadística, Finanzas y Proyectos. Su especialidad es la aplicación de métodos cuantitativos en la gestión empresarial.

Está vinculado al sector de hidrocarburos hace más de 10 años, actualmente se desempeña como Jefe de Planificación y Nuevos Negocios en YPFB Andina S.A.