

CURSO PRESENCIAL:

GESTIÓN DE RIESGO: PORTAFOLIO DE ACTIVOS Y PROYECTOS



GESTIÓN EMPRESARIAL

INFORMACIÓN IMPORTANTE

Fechas: 14 al 17 de mayo de 2024.

Sesiones: Martes a viernes.

Horario: De 19:00 a 22:00 hrs.

Modalidad: Presencial (Laboratorio de Pregrado).

Inversión: 900 Bs.-

Contacto: Ronie Krukliis

Telf. 3464000 (int. 218)

Cel. 62100810 - email: cenace@upsa.edu.bo

OBJETIVO

Se busca introducir a los participantes en la gestión de riesgos a través de métricas y la identificación de objetivos. Al finalizar el curso el participante estará familiarizado con la composición de portafolios de activos financieros y proyectos de inversión, para gestionar la exposición al riesgo.

REQUISITOS

Conocimientos básicos de Finanzas y Estadística.

PERFIL DEL PARTICIPANTE

Este curso está dirigido a los responsables de la colocación de inversiones financieras y reales, responsables de planificación estratégica, gestores de proyectos y personas interesadas en la gestión del riesgo a través de la combinación de activos y proyectos.

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.

CURSO PRESENCIAL:

GESTIÓN DE RIESGO: PORTAFOLIO DE ACTIVOS Y PROYECTOS



GESTIÓN EMPRESARIAL

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.

CERTIFICACIÓN

Se entregará un certificado de participación avalado por la Universidad Privada de Santa Cruz de la Sierra (UPSA). Podrán acceder a dicha certificación quienes cumplan como requisito una asistencia mínima y presentación de los trabajos del 80%.

CONTENIDO DEL PROGRAMA DE CAPACITACIÓN

Introducción a la Medición del Riesgo

- Caracterización de Riesgo de los Activos
 - Estadística Descriptiva
 - Tendencia Central
 - Posición
 - Dispersión y Riesgo
 - Forma
 - Estadística Inferencial
 - Intervalos de Confianza
 - Pruebas de Hipótesis
- Diversificación del Riesgo

Teoría Clásica de Portafolio

- Minimizando el Riesgo
 - Varianza Global Mínima
 - Semivarianza de Markowitz
- Optimizando la relación rentabilidad vs. Riesgo
 - Función de Utilidad

CURSO PRESENCIAL:

GESTIÓN DE RIESGO: PORTAFOLIO DE ACTIVOS Y PROYECTOS



GESTIÓN EMPRESARIAL

- Ratio de Sharpe
- Ratio de Sortino
- Emulando el mercado
 - Betas equivalentes
 - Ratio de Treynor
- Portafolio No Paramétrico
 - Omega de Keating
 - Value at Risk (VaR)
 - Conditional Value at Risk (CVaR)

Teoría de Portafolio con Aplicación Dinámica

- Introducción al Análisis de Riesgo
 - Caracterización de variables Input
 - Simulación de Monte Carlo
 - Medición de riesgo en indicadores Output
- Modelado y Optimización con Riesgo
 - Aplicación a Portafolios

Portafolio de Proyectos de Inversión

- Introducción a Evaluación de Proyectos
 - Indicadores de Viabilidad
 - Indicadores de Eficiencia y Rentabilidad
- Ejemplos de Aplicación
 - Definición de la Cartera de Proyectos (sin joint ventures)
 - Definición de la Cartera de Proyectos (con joint ventures)

INSTRUCTOR

JUAN FERNANDO SUBIRANA OSUNA

Candidato a Doctor en Economía y Finanzas y Candidato a Doctor en Ciencias Económicas, Magíster en Ingeniería Financiera de la UPSA, cuenta con formación en Diplomados en Bolivia, Perú y Ecuador en Educación Superior, Gestión y Tecnología del Gas Natural, Econometría Aplicada, Macroeconometría,

CURSO PRESENCIAL:

GESTIÓN DE RIESGO: PORTAFOLIO DE ACTIVOS Y PROYECTOS



GESTIÓN EMPRESARIAL

Econometría Financiera y Evaluación de Impacto, es Especialista en Forecasting Aplicado y Certificado en Administración y Análisis de Riesgo Avanzado (CRM).

Es Ingeniero Comercial de la UPSA.

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

Tiene experiencia de dos décadas en el sector de hidrocarburos, gestión pública y consultoría empresarial. Actualmente se desempeña como analista económico, divulgador científico y consultor empresarial en áreas estratégicas, financieras y de análisis de datos. Es Director Académico del Centro de Formación Superior CRECE, dependiente de la Fundación CRE y forma parte del grupo de investigadores de la Academia Nacional de Ciencias y del CEPAD