

CURSO PRESENCIAL:

GESTIÓN DE RIESGO: PORTAFOLIO DE ACTIVOS Y PROYECTOS



GESTIÓN EMPRESARIAL

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.

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

CURSO PRESENCIAL:

GESTIÓN DE RIESGO: PORTAFOLIO DE ACTIVOS Y PROYECTOS



GESTIÓN EMPRESARIAL

- Optimizando la relación rentabilidad vs. Riesgo
 - Función de Utilidad
 - 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)

METODOLOGÍA

Los encuentros serán de carácter predominantemente práctico, permitiendo el intercambio de criterios, opiniones y experiencias entre los participantes y el facilitador.

CURSO PRESENCIAL:

GESTIÓN DE RIESGO: PORTAFOLIO DE ACTIVOS Y PROYECTOS



GESTIÓN EMPRESARIAL

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.

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%.

INSTRUCTOR

JUAN FERNANDO SUBIRANA OSUNA

Candidato a Doctor en Economía y Finanzas por la UPB y Candidato a Doctor en Ciencias Económicas y Empresariales por la Business School UAGRM, Máster en Ingeniería Financiera de la UPSA, Diplomado en «Gestión y Tecnología del Gas Natural», «Educación Superior», «Macroeconometría, Econometría Financiera y Evaluación de Impacto» y «Estadística Matemática» e Ingeniero Comercial; especialista en administración y análisis de riesgo certificado. Docente en las áreas de Estadística, Econometría, Finanzas y Proyectos. Su especialidad es la aplicación de métodos cuantitativos en la gestión empresarial.

Cuenta con vasta experiencia en el sector de hidrocarburos, fue gerente de planificación, representante legal y director en empresas del rubro petrolero, universidades y en el sector público. Actualmente es Analista Económico, Consultor Empresarial, Científico de Datos, Docente Universitario y Experto en el Sector de Energía.