

## 1. INFORMACIÓN GENERAL

<b>Nombre del programa:</b>	Análisis de Riesgo
<b>Tipo de programa:</b>	Curso
<b>Facultad articulada:</b>	Facultad de Ingenierías
<b>Programa articulado:</b>	Facultad de Ingeniería / Laboratorio Financiero
<b>Duración:</b>	36 Horas
<b>Público objetivo:</b>	Profesionales del mercado de valores, gerentes de entidades financieras y de empresas exportadoras e importadoras, personal del área financiera, profesionales de otras disciplinas que deben o desean adquirir conocimientos y habilidades que les permitan realizar un adecuado análisis del riesgo.
<b>Justificación:</b>	El riesgo es un factor importante dentro de las organizaciones, el cual se debe gestionar y administrar, de modo que este sea minimizado al máximo. Por ello es importante contar con herramientas para dicha administración, donde se pueda modelar y realizar las proyecciones para la toma de decisiones.
<b>Objetivo general:</b>	Brindar herramientas para entender los conceptos inherentes al proceso de toma de decisiones bajo riesgo e incertidumbre, y aplicar las técnicas necesarias para llevar a cabo un análisis de riesgo para tomar una decisión defendible utilizando el software @ RISK.
<b>Objetivos específicos:</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Proveer los conceptos básicos sobre el riesgo.</li> <li>• Utilizar @risk para la modelación del riesgo.</li> <li>• Aprender herramientas para la toma de decisiones efectivas.</li> <li>•</li> </ul>
<b>Competencias a adquirir:</b>	Al terminar el curso los asistentes estarán en capacidad de: <ul style="list-style-type: none"> <li>• Utilizar correctamente @risk para la parametrización de riesgos.</li> <li>• Aplicar las diferentes metodologías de medición y administración de riesgo.</li> </ul>
<b>Conocimientos previos requeridos:</b>	Matemáticas financieras, nociones de riesgo financieros.

<b>2. ESTRUCTURA</b>		
<b>Módulo</b>	<b>Temas</b>	<b>Intensidad horaria</b>
<b>MODULO I INTRODUCCIÓN AL ANÁLISIS DE RIESGO O UTILIZANDO @RISK</b>	<b>Parametrización de Modelos</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Distribuciones de probabilidad.</li> <li>• Introducción al @RISK utilizando un ejemplo simple.</li> <li>• Aprendiendo a utilizar @RISK y sus funciones: Distintos Ejemplos.</li> <li>• El proceso de tomas de decisión</li> <li>• Introducción al análisis de Riesgo.</li> <li>• Introducción a la simulación.</li> </ul>	<b>16</b>
<b>MODULO II CREACIÓN DE MODELOS Y ANÁLISIS DE RIESGO E INTERPRETACION DE RESULTADOS</b>	<b>Seleccionar una distribución de probabilidad adecuada</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Seleccionar una distribución de probabilidad a partir de datos disponibles (Bestfit).</li> <li>• Correlación e interdependencia entre las variables de entrada.</li> <li>• Incorporar la incertidumbre a lo largo del tiempo. Construyendo modelos @RISK: Ejercicios.</li> <li>• Análisis de sensibilidad (Grafico tornado)</li> <li>• Estadísticas básicas de resultado.</li> <li>• Interpretación y generación.</li> </ul>	<b>20</b>
<b>3. METODOLOGÍA</b>		
<b>Estrategias didácticas:</b> Clase magistral, Deductivo – inductivo.		
<b>4. CONFERENCIANTES</b>		
Docentes avalados por el programa de Ingeniería Financiera. La Universidad de Medellín se reserva el cambio de docentes.		