

## Taller

### Taller Didáctico Presencial Stata y Risk Simulator: Complementos, Pronósticos y Simulación de Datos

#### Descripción

El taller abordará desde un enfoque sencillo y práctico algunas metodologías de simulación y pronóstico. Risk Simulator 2011 es un software ambientado en Microsoft Excel, que permite analizar y evaluar decisiones bajo incertidumbre. Contiene importantes herramientas analíticas que le permiten ampliar su capacidad predictiva para toma de decisiones. STATA 11 es un software estadístico y econométrico utilizado en las principales universidades, centros de investigación y empresas privadas y públicas, que contiene un gran conjunto de procedimientos estadísticos desde niveles básicos hasta avanzados.

#### Dirigido a

Ejecutivos, estudiantes, docentes y profesionales de todas las ramas (La industria farmacéutica, exploración minera, petrolera, banca, construcción, servicios, sector financiero y empresa que requiera evaluar inversiones de capital o posean cualquier tipo de incertidumbre y riesgo, así como su interés sea pronosticar información) interesados en mejorar la toma de decisiones.

#### Objetivo

El taller ha sido diseñado para demostrar una amplia variedad de aplicaciones en finanzas, ingeniería, administración de proyectos y otros. Utilizando simulaciones de Monte Carlo, y Pronósticos con los software STATA y Risk Simulator.

#### Temario

- ¿Qué es pronosticar y su importancia?
- Tipos de datos para pronosticar
- Simulación de Monte Carlo como herramienta de pronóstico
- Manejo de series de tiempo
- Suavizamiento de series de tiempo
- Modelos ARIMA para pronóstico
- Modelos especiales de pronóstico

#### Instructores

Brayan Ricardo Rojas Ormaza, Mag.

Economista, especialista en gestión de riesgos financieros y magíster en finanzas, cuenta con la certificación CQRM y la certificación Financial Risk Management (FRM). Actualmente es el líder del área de consultoría y auditoría de gestión de riesgos financieros de KPMG Colombia desempeñándose como Director, ha sido gerente de consultoría en KPMG Panamá y líder del área cuantitativa en Software Shop. Cuenta con amplia experiencia en construcción, modelación, revisión, auditoría y asesoría de modelos de gestión de riesgo de mercado, crédito, operacional y liquidez en entidades financieras y no financieras con el uso de herramientas cuantitativas y cualitativas.

## Información General

#### Duración

2 horas

#### Fecha de Inicio

Vie. 01 de Abr de 2011

#### Horarios

9.00 a.m. a 12.00 m.

## Ciudad

Lima (Lima, Perú)

## Lugar:

Universidad Peruana de Ciencias Aplicadas



Mayores informes de inscripción y costos

Entrenamientos@Software-Shop.com

## Políticas

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

Inscríbete ahora