

Entrenamiento Especializado

Uso de Risk Simulator como herramienta para la toma de decisiones: Simulación, Optimización, Pronósticos y Árboles de Decisión.

Descripción

En este entrenamiento se abordará desde un enfoque sencillo y práctico las diferentes maneras para tomar decisiones, utilizando Simulación de Monte Carlo, Optimización y el Pronósticos.

Dirigido a

El entrenamiento está dirigido a aquellas personas interesadas en el manejo del software Risk Simulator como herramienta para la Toma de Decisiones.

Objetivo

1. Enseñar al participante el manejo del software de manera intuitiva y práctica.
2. Introducir al participante en técnicas de simulación por múltiples escenarios.
3. Analizar e interpretar resultados estadísticos de manera gráfica y numérica.
4. Entender la Simulación de Monte Carlo como metodología para la modelación de incertidumbre en las decisiones de inversión.

Temario

1. Conceptos básicos de estadística para la toma de decisiones

- Estadística Descriptiva

Medidas de Variabilidad o Dispersión

Medidas de Forma de Distribución y Ubicación Relativa.

Medidas de Asociación

- Probabilidad y Variables Aleatorias
- Teorema Central del Límite (Conceptos Básicos)
- ¿Qué es la Simulación de Montecarlo? (Ej VPN en MS Excel)

2. Selección del tamaño de muestra óptimo

-Tamaño de muestra óptimo

- Determinantes del tamaño de muestra.
- Selección de Muestras Aleatorias (Coordinado Negativo)

3. Introducción al Software

¿Qué es Risk Simulator?

-Aplicaciones Generales

- Herramientas analíticas
- Pronóstico
- Simulación
- Optimización
- Árboles de decisión

-Manejo de los menús

4. Simulación de Monte Carlo

-Simulación de Monte Carlo e Hipercubo Latino

-Variables de Entrada y Pronóstico

-Edición de Variables

-Ajuste de Distribución Automático y Pruebas de Bondad de Ajuste

- Variables Continuas
- Variables Discretas

-Preferencias de la Simulación y Nivel de Precisión

-Ejecución del Modelo

-Análisis de las Estadísticas de Simulación

-Análisis Tornado, Araña y de Sensibilidad

-Correlación de Supuestos de Entrada

-Generación de Reportes

-Extracción de Resultados

-Importación de Resultados

Ejemplos: Simulación de Ventas, Ajuste de Distribución de Producción, Ingresos, Compras, Precios, Commodities.

5. Optimización

-Optimización de Portafolios

-Optimización Estática, Dinámica y Estocástica

-Ejercicio de Optimización

6. Pronóstico

- Introducción a la Econometría
- ¿Qué es Regresión?
- ¿Qué son los Modelos de Series de Tiempo?
- Modelos Básicos de Pronóstico (Promedio Móvil Simple, Doble, Suavizamiento Exponencial, Holt Winters Aditivos y Multiplicativos)
- Pronóstico Spline Cúbico (Extrapolación e Interpolación)
- Modelos ARIMA
- Modelos GARCH

- Modelos de Máxima Verosimilitud (Logit y Probit).

7. Árboles de Decisión

¿Qué es un Árbol de Decisión?

- Elementos de un Árbol de Decisión
- Valor Monetario Esperado

Instructores

Fernando Jáuregui Puertas

Acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgos CRM, impartida con el Dr. Jonathan Mun. Profesional en Ciencias Económicas de la Universidad Nacional de Ingeniería del Perú. Executive Master in Financial Analysis en la Universidad Carlos III de Madrid (España). Adicionalmente, cuenta con especialización en Gestión de Riesgos Financieros en BURSEN (Centro de Estudios Bursátiles de la Bolsa de Valores de Lima) y en Formulación y Evaluación de Proyectos de Inversión Pública en la Universidad ESAN. Actualmente es docente de la Maestría en Finanzas de la Universidad del Pacífico (Perú) e instructor de SOFTWARE shop para LATAM. Tiene experiencia en el sector público como Analista de Proyectos de Inversión y en el Sector Bancario como Analista de Estudios Económicos. Anteriormente se desempeñó como docente de la Facultad de Ingeniería Económica de la Universidad Nacional de Ingeniería (Perú), en las asignaturas de Econometría II y Análisis de Series Temporales.

Información General

Duración

16 Horas

Fecha de Inicio

Lun. 04 de May de 2015

Horarios

Fechas:

Mayo 4,5, 6, 7 y 8 de 2015

Horario:

14:00 a 18:00

Ciudad:

Lima. Perú

Ciudad

Lima (Lima, Perú)

Lugar:

Peruvian Event S.A.



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