

Entrenamiento Especializado

Entrenamiento Presencial: Toma de Decisiones usando Risk Simulator.

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 Hiper cubo 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

Miguel Ángel Bello Bernal, Mag.

Instructor de econometría y riesgo en Software Shop para Latinoamérica, economista de la Universidad de la Salle, con Maestría en Administración y Dirección de Empresas de la Universidad Villanueva en Madrid-España, actualmente está cursando la Maestría en Finanzas Cuantitativas en la Universidad del Rosario en Colombia. Se ha desempeñado como profesor de estadística, toma de decisiones y econometría financiera en especializaciones y maestrías en varias Universidades de Colombia, como: CESA, Universidad del Norte, Universidad del Rosario, Universidad EAFIT, Universidad Piloto y Universidad Jorge Tadeo Lozano. Ha impartido entrenamientos especializados en materia de análisis de riesgos en entidades internacionales como: Comisión Nacional de Acreditación (Chile); Ministerio de Economía y Finanzas del Perú, OSITRAN, Organismo de Evaluación y Fiscalización Ambiental del Perú (Perú); Banco Económico de Bolivia, Banco Fossil S.A., Universidad Privada de Santa Cruz (Bolivia); Superintendencia de Industria y Comercio, Fondo Nacional del Ahorro, Grupo Saludcoop, La Equidad Seguros, FINDETER S.A., Bolsa de Valores de Colombia, Cámara Colombiana de Infraestructura, Universidad EAFIT, Fundación Universidad de América (Colombia); Banco Central de Costa

Información General

Duración

16 horas

Fecha de Inicio

Lun. 02 de May de 2016

Horarios

Fechas:

Mayo 2 al 5 de 2016

Horarios:

De 14:00 a 18:00

Dirección:

Evotech - Solution Calle German Schreiber 210-220 Oficina 401 San Isidro
Lima - Perú

Ciudad

Lima (Lima, Perú)

Lugar:

Evotech - Solution



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