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 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

Miguel Ángel Bello Bernal

Economista de la Universidad de la Salle y MBA de la Universidad Villanueva en España. Actualmente, está acreditado con la Certificación Internacional en Gestión de Riesgos-CQRM impartida por el Dr. Johnathan Mun. Consultor y formador especialista en Software Shop. Profesor de estadística, econometría y analitica de datos, a nivel de pregrado y posgrado en el Colegio de Estudios Superiores de Administración (CESA) y otras universidades de Colombia. Cuenta con 7 años de experiencia como conferencista y capacitador internacional en análisis de riesgo y métodos cuantitativos para mejorar la toma de decisiones bajo escenarios de incertidumbre.

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

Herramientas de apoyo

Risk Simulator

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