Entrenamiento Especializado

Entrenamiento Especializado en: Medición de Riesgos en la Toma de Decisiones con el apoyo de Risk Simulator.

Descripción

En este entrenamiento se abordará desde un enfoque sencillo y práctico los diferentes tipos de riesgo ofreciendo al participante herramientas que le permitirán complementar los conocimientos en la administración y la gestión del riesgo. Al final del entrenamiento usted contará con información suficiente para solucionar casos habituales como:
 1. Modelación de la incertidumbre a partir de Distribuciones de Probabilidad. 2. Evaluar Decisiones de Inversión a partir del VAN y la TIR Bajo
 3. Incertidumbre 3. Realizar pronósticos de Variables Inciertas 4. Optimizar Decisiones de Inversión de Proyectos y Portafolios 5. Evaluación de Inversiones a través de Árboles de Decisión

Dirigido a

El entrenamiento está dirigido a aquellas personas interesadas en la Medición de Riesgos en la Toma de Decisiones cubriendo el marco teórico, sin exponerse de manera extensa a los detalles complicados de Modelos Matemáticos, logrando habilidades que les permitan desempeñarse de forma más eficiente en el mundo del riesgo utilizando herramientas especializadas.

Objetivo

- Introducir al participante en Técnicas de Simulación por múltiples escenarios.
- Analizar e interpretar resultados estadísticos de manera gráfica y numérica.
- Mostrar al participante la importancia de la Gestión de Riesgos en presencia de Incertidumbre.
- Entender la simulación de Monte Carlo como metodología para la modelación de incertidumbre en las Decisiones de Inversión.
- Proporcionar procedimientos para realizar un análisis integrado de riesgos a través del uso de herramientas especializadas como Risk Simulator.

Temario

¿Qué es y por qué nos interesa conocer el Riesgo?

El concepto de Riesgo
Definición de Riesgo
El Riesgo y las Decisiones Estratégicas.
Procedimiento general para la Gestión del Riesgo.
Transferencia del Riesgo.

¿Por qué es importante las Herramientas Estadísticas?

Conceptos básicos de estadística para la toma de decisiones.
Medidas de localización.
Medidas de variabilidad.

Medidas de distribución y ubicación relativa.
Medidas de asociación.
Introducción a la probabilidad.
Distribuciones discretas de probabilidad.
Distribuciones continuas de probabilidad.
Pruebas de hipótesis.

¿Qué es y para qué sirve la Simulación de Montecarlo en el Mundo Real?
Simulación de Montecarlo Simulación de Montecarlo.
Variables de entrada y pronóstico.
Edición de variables.
Análisis de las estadísticas de la simulación.
Truncamiento y correlación.
Herramientas Analíticas.
Ajustes de distribución.
Análisis tornado, araña y sensibilidad dinámica.
Análisis de escenarios.
Si tengo múltiples opciones y tengo restricciones de tiempo y presupuesto, ¿qué debo hacer?

¿Cómo podría utilizar la Optimización para construir Portafolios de Inversión?
Introducción a la optimización.
Optimización estática.
Optimización Dinámica.
Optimización Estocástica.
Tomar decisiones con anticipación, permitiría adaptarse al entorno, entonces, ¿cómo se debe evaluar una técnica de pronóstico en particular?
Pronóstico

¿Qué son las series de tiempo?
Modelos de series de tiempo: promedios móviles, suavizamiento exponencial, Holt-Winters. Modelos ARIMA.
Pronóstico de la Volatilidad Condicional.
¿Qué pasaría si se quiere hacer un análisis alternativo al valor presente neto (VPN)?

¿Qué son las Opciones Reales?
Introducción a las opciones reales.
Elementos a considerar.
Tipos de estrategias de opciones reales.
Análisis de opciones reales.

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
20

Fecha de Inicio
Lun. 27 de Jun de 2016

Horarios
Fechas:
Junio 27, 28, 29, 30 y 01 de Julio de 2016

Horario:
14:00 a 18:00

Lugar:
Escuela Militar de Ingeniería
Laboratorio de Informática de la EMI Central (Subsuelo)
Av. Arce No. 2642 Frente a Multicine

Ciudad:
La Paz (La Paz, Bolivia)

Ciudad
La Paz (La Paz, Bolivia)

Lugar:
Escuela Militar de Ingeniería

Herramientas de apoyo

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