

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, Mag.

Economista de la Universidad de la Salle, Magíster en Administración y Dirección de Empresas de la Universidad Villanueva en Madrid-España y acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgo - CQRM, impartida por el Dr. Johnathan Mun y otorgada por el Instituto IIPER. Actualmente, es consultor y docente en el Colegio de Estudios Superiores de Administración (CESA), además, se ha desempeñado como docente y director de tesis de maestría en diferentes universidades de la región así como expositor internacional e instructor especializado en temas de riesgo y finanzas como parte del equipo de instructores de Software Shop para Latinoamérica.

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



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