Webcast

Sesión II: Simulaciones de Montecarlo

Descripción

Una de las herramientas de métodos cuantitativos para la toma de decisiones y solución de problemas es la simulación. La simulación es en su esencia mínima, la posibilidad de realizar inferencia estadística a partir de una cantidad muy grande de escenarios. «Con frecuencia, la simulación Monte Carlo se considera como un paso que va más allá tanto del análisis de sensibilidad como del análisis de escenarios. En el Monte Carlo las interacciones entre las variables están explícitamente especificadas; por lo tanto (por lo menos en teoría) esta metodología proporciona un análisis más completo. Y, como un subproducto, tener que construir un modelo preciso permite que quien hace el pronóstico amplíe y profundice la comprensión del proyecto.» Tomado de: Finanzas Corporativas (Ross, Westerfield, Jaffe), octava edición, McGraw-Hill, p.225

Dirigido a

Profesionales, investigadores, docentes, estudiantes y en general a todas las personas que estén interesadas en el aprendizaje e implementación del concepto de múltiples escenarios aleatorios (Simulación de Montecarlo).

Objetivo

- Dar a conocer el concepto de simulación y la vinculación de este concepto con el de incertidumbre. - Entender cómo realizar Simulaciones de Montecarlo en un software especializado (Risk Simulator) - Repasar elementos y herramientas asociadas al concepto de simulación.

Temario

- Números Aleatorios
- Distribución de probabilidad
- Parámetros
- Supuestos de entrada y Pronósticos de salida
- Ajustes distribucionales
- Análisis de Tornado y Sensibilidad
- Correlación de variables para la simulación
- Simulación multidimensional Bootstrapping

Instructores

Julián Andrés Meléndez Cardona

Acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgo - CQRM, impartido por el Dr. Johnathan Mun y otorgado por el Instituto IIPER. Economista con Especialización en Gerencia de Mercadeo de la Universidad Externado de Colombia. Cuenta con amplia experiencia en temas de Valor de Dinero en el Tiempo y en Análisis y Planeación Financiera de entidades en los sectores Financiero y Real. En el campo académico trabajó como docente en temas de Econometría y Finanzas en la Universidad Externado de Colombia y en la Fundación Universitaria Los Libertadores. Actualmente se desempeña como Gerente de Producto del Portafolio Cuantitativo de SOFTWARE shop para Latinoamérica.

Información General

Duración

1 hora

Fecha de Inicio

Jue. 28 de Abr de 2016

Horarios

Hora de Inicio por País

San José de Costa Rica 10:00 a.m
México D.F. 11:00 a.m
Bogotá 11:00 a.m
Quito 11:00 a.m
Lima 11:00 a.m
Caracas 11:30 a.m
Bolivia 12:00 m
Buenos Aires 1:00 p.m
Santiago 1:00 p.m

Herramientas de apoyo

Risk Simulator

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