

Entrenamiento Especializado

Entrenamiento Online: Uso de Risk Simulator como Herramienta para la Toma de Decisiones. DUMMY EEAD RISK S

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

Dirigido a profesionales de diferentes áreas del conocimiento, a profesores y a estudiantes, interesados en el manejo del software Risk Simulator para la Toma de Decisiones.

Objetivo

- Enseñar al participante el manejo del software de manera intuitiva y práctica.
- 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.

Temario

1. Conceptos básicos de estadística para la toma de decisiones

- Estadística Descriptiva Medidas de localización
Medidas de variabilidad
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

- Sobreposición de variables

- Correlación de supuestos

- Generación de reportes

- Extracción de resultados

- Importación de Resultados

**Ejemplo de Simulación de Ventas, Ajuste de Distribución de Producción, Ingresos, Compras, Precios, Commodities.

5. Introducción al Riesgo

a. Tipos de Riesgo

b. Importancia del análisis de variables

c. Gestión del Riesgo

6. Riesgo de Crédito con Risk Simulator

a. Análisis de modelos LOGIT

b. Cálculo de probabilidades de default

c. Pérdidas Esperadas

7. Riesgo de Mercado con Risk Simulator

a. Value at Risk (VaR)

b. Metodologías de medición del VaR.

c. Utilización de la simulación de Montecarlo en el cálculo del VaR

d. Backtesting

8. Riesgo operativo

a. Cálculo de pérdidas esperadas por MMA.

9. Optimización

- a. Optimización de Portafolios usando Risk Simulator
- b. Optimización estática, dinámica y estocástica
- c. Ejercicios de optimización

10. Pronóstico

- a. Introducción a la Econometría
- b. ¿Qué es Regresión?
- c. Modelo CAPM
- d. ¿Qué son los Modelos de Series de Tiempo?
- e. Modelos Básicos de Pronóstico (Promedio Móvil Simple, Doble, Suavizamiento Exponencial, Holt Winters Estacionales)
- f. Pronóstico Spline Cúbico
- g. Modelos ARIMA.

Casos aplicados:

Selección de muestras aleatorias (Media y proporciones)

Optimización de portafolios de inversión: proyectos y acciones

Riesgo de Mercado: Bonos y renta variable

Riesgo de crédito: Modelos de scoring de crédito (Modelos Logit y Probit)

Riesgo operativo

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 analítica 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

Dom. 31 de Dic de 2023

Horarios

Herramientas de apoyo



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