

Entrenamiento Especializado

Entrenamiento Online: La Simulación de Monte Carlo como herramienta en la Toma de Decisiones.

Descripción

La toma de decisiones, desde las más básicas y rutinarias hasta las más complejas y estratégicas, hacen parte de la vida diaria desde cualquiera de las dimensiones que quiera ser aproximada. Para los diferentes individuos, bien sean corporativos, financieros, gubernamentales, académicos o los involucrados con la administración y puesta en marcha de proyectos, la esencia de la toma de decisiones descansa en supuestos que se crean sobre el futuro y por ende están sujetos a incertidumbre. Poder cuantificar y gestionar dicha incertidumbre es un reto que no sólo favorecerá una mejor asignación de recursos sino que minimizará las exposiciones o pérdidas en caso de que las cosas salgan mal generando valor a los accionistas.

Dirigido a

Profesionales en estadística, finanzas, economía, administración de empresas, ingenierías, analistas de riesgos, docentes y en general, a todas las personas que trabajen o estén interesadas en aplicar técnicas y conceptos referentes a la Gestión Integral de Riesgos en sus labores cotidianas.

Objetivo

- Desarrollar las destrezas y habilidades necesarias para el manejo idóneo de la simulación como herramienta soporte en las decisiones de inversión.
- Presentar algunas técnicas apropiadas para el análisis y modelamiento de riesgo y rendimiento, así como de otras variables económico-financieras.
- Enseñar al participante el manejo del software de manera intuitiva y práctica.

Temario

1. Introducción al Concepto de Simulación

Números Aleatorios

Escenarios

Modelos

2. Estadística para la Simulación

Medidas de Tendencia Central

Medidas de Dispersión o Variabilidad
Medida de Asimetría
Medida de Curtosis
Medidas de Asociación Lineal y No Lineal
Pruebas de Hipótesis
Distribución de Probabilidad para Variable Aleatoria Discreta
Distribución de Probabilidad para Variable Aleatoria Continua

3. Introducción a Risk Simulator

Perfiles
Supuestos de Entrada
Pronóstico de Salida
Herramientas Analíticas
Ajustes de Distribución

4. Caso Aplicado para la Formulación de Proyectos de Inversión

Análisis de Sensibilidad Estático: Tornado y Araña
Análisis de Escenarios
Análisis de Sensibilidad Dinámico
Optimización de Proyectos de Inversión
Construcción de la Frontera
EficienteModelo de Estimación de Costos

5. Optimización

Características de una Optimización
Optimización de Proyectos de Inversión (Presupuesto-Riesgo)
Optimización de Portafolios

6. Pronóstico de Series de Tiempo

Componentes de una serie de Tiempo
Técnicas de Suavizamiento
Mecanismos para juzgar las técnicas de Pronóstico
Introducción a la Metodología Box-Jenkins (ARIMA)

7. Árboles de Decisión

¿Cómo construir un Árbol de Decisión?
Elementos de un Árbol de Decisión
Diseño del Árbol de Decisión
Incluir Incertidumbre en los Nodos Monetarios y de Probabilidad
Análisis de Sensibilidad
Análisis de Escenarios

Al final del curso usted podrá solucionar los siguientes problemas:

- Evaluar decisiones de inversión a partir del VAN y la TIR bajo Incertidumbre.

- Modelación de la Incertidumbre a partir de distribuciones de probabilidad.
- Realizar pronósticos de variables inciertas.
- Optimizar decisiones de inversión de proyectos.
- Diseñar diagramas de influencia para la solución de problemas.

Instructores

Andrés Raúl Cruz Hernández

Instructor del Portafolio - Riesgo y Finanzas en Software Shop. Profesional en Finanzas y Comercio Internacional de la Universidad de La Salle. Magíster en Investigación en Administración (énfasis en finanzas) de la Universidad de los Andes. Acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgos Cuantitativos CQRM, actualmente adelanta estudios de Doctorado en Administración en la Universidad de los Andes, Colombia. .

Información General

Duración

18 horas

Fecha de Inicio

Mar. 12 de Dic de 2017

Horarios

Diciembre 12, 13, 14, 19, 20 y 21 de 2017

Sesiones: Martes, Miércoles y Jueves

Tres horas por sesión

Hora de inicio por país

4:00 p.m. San José de Costa Rica - CDMX

5:00 p.m. Bogotá - Lima - Quito

5:30 p.m. Caracas

6:00 p.m. La Paz

7:00 p.m. Santiago de Chile - Buenos Aires

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