Entrenamiento Especializado

Entrenamiento online: Iniciación a la Administración Cuantitativa de Riesgo.

Descripción

En este entrenamiento se abordarán, desde un enfoque sencillo y práctico, las diferentes herramientas analíticas con las que cuenta Risk Simulator para cuantificar el riesgo en el procesos de toma de decisiones de manera eficiente, así como los conceptos necesarios para comprender su aplicación en diferentes escenarios e industrias.

Dirigido a

El entrenamiento está dirigido a estudiantes y profesionales de diferentes áreas del conocimiento interesados en el análisis cuantitativo para la toma de decisiones utilizando el software Risk Simulator.

Objetivo

Introducir al participante por los principales conceptos relacionados a la toma de decisiones aplicando herramientas analíticas y software especializado.

Temario

1. Introducción.
1.1. Requisitos y procedimiento de instalación.
1.2. Licencias.
1.3. Capacidades generales.
1.4. Principales Módulos.
1.5. Solución de Problemas.

2. Simulación de Monte Carlo.
2.1. Conceptos Elementales de Estadística.
2.2. Principales Distribuciones de Probabilidad.
2.3. Concepto y aplicación de la Simulación de Monte Carlo.
2.4. Correlaciones y control de precisión.
2.5. Interpretación de resultados.

3. Pronóstico.
3.1. Técnicas de pronóstico.
3.1.1. Análisis de series de tiempo.
3.1.2. Regresión múltiple.
3.1.3. Extrapolación no Lineal.
3.1.4. ARIMA.
3.1.5. Modelos de Máxima Verosimilitud.
3.1.6. Líneas de Tendencia.
3.1.7. Spline cúbico.

4. Optimización.
4.1. Metodología de Optimización.
4.2. Optimización con variables de decisión continua.

4.3. Optimización con variables de decisión enteras.
4.4. Generación de la Frontera eficiente.

5. Herramientas Analíticas.
5.1. Tornado.
5.2. Sensibilidad.
5.3. Ajuste de distribución.
5.4. Simulación de Ajuste.
5.5. Prueba de Hipótesis.
5.6. Extracción de Datos.
5.7. Herramientas de Diagnóstico.
5.8. Herramienta de Análisis Estadístico.
5.9. Herramienta de Análisis Distribucional.
5.10. Herramienta de Análisis de Escenarios.
5.11. Herramienta de Segmentación.
5.12. Desestacionalización y eliminación de tendencias en Datos.
5.13. Análisis de Componentes Principales.
5.14. Examen de Cambio Estructural.
5.15. Verificación de Modelo.

Durante las sesiones se tendrán ejemplos aplicados en:

-Proyectos de Inversión.
-Optimización de Portafolios.
-Riesgo de Mercado y Crédito.
-Costos y Presupuesto.

Instructores

Wilmer Ramírez

Ingeniero financiero de la Universidad Piloto de Colombia, acreditado con la Certificación Internacional en Administración Cuantitativa de Riesgos CQRM, con formación en Bloomberg, auditoría interna ISO 9001, NIC (Normas Internacionales de Contabilidad) y NIIF (Normas Internacionales de Información Financiera). Cuenta con experiencia en solución de problemas en áreas administrativas, contables y financieras en empresas del sector real y estatal. Actualmente se desempeña como instructor especializado del área de Riesgo y Finanzas en Software Shop

Información General

Duración

24 horas

Fecha de Inicio

Mie. 23 de Ene de 2019

Horarios

Fechas:
Enero 23 a Febrero 7 de 2019

Programación de las sesiones:
Martes, miércoles y jueves
Duración de cada sesión: 3 horas

Hora de inicio por país:
4:30 p.m San José de Costa Rica
5:30 p.m CDMX - Bogotá - Quito - Lima
6:30 p.m La Paz - Caracas
7:30 p.m Buenos Aires - Santiago de Chile

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