Webcast

Análisis de Decisiones y Cuantificación del Riesgo

Descripción

La Simulación de Monte Carlo es el método más utilizado por analistas cuantitativos para generar múltiples escenarios, analizar e interpretar resultados para la gestión del riesgo y tomar decisiones en entornos con alta incertidumbre.
 En este webcast se abordarán los conceptos necesarios para realizar un buen modelo y aplicar esta metodología.

Dirigido a

Dirigido a Vicepresidentes, Gerentes y Analistas de todos los sectores económicos interesados en mejorar sus conocimientos y habilidades para la cuantificación de riesgos aplicando la Simulación de Monte Carlo.

Objetivo

- Desarrollar el marco conceptual y práctico para resolver situaciones que involucran incertidumbre, estadística y probabilidad.
- Utilizar Microsoft Excel y Risk Simulator como herramientas de apoyo para la generación de número aleatorios y la posterior toma de decisiones.
- Implementar y entender el Análisis de Simulación Monte Carlo en un modelo financiero básico.

Temario

1. Definición de Riesgo e Incertidumbre.
2. Falla de los Promedios.
3. Proceso de la Gestión Integral de Riesgos.
4. ¿Qué es la Simulación de Monte Carlo?
5. Modelo y Modelado Determinístico.
6. Principales Distribuciones de Probabilidad.
7. Caso Aplicado en Microsoft Excel.
8. Caso Aplicado con Risk Simulator.

Instructores

Miguel Ángel Bello Bernal, Mag.

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 analitica 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
1 hora

Fecha de Inicio
Jue. 21 de Mar de 2019

Horarios
2:00 p.m San José de Costa Rica - CDMX
3:00 pm Bogotá - Quito - Lima
4:00 p.m La Paz - Caracas
5:00 p.m Buenos Aires - Santiago de Chile

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