

Entrenamiento Especializado

ENTRENAMIENTO ESPECIALIZADO EN SOFTWARE DE SIMULACION, OPTIMIZACION, PRONÓSTICO Y HERRAMIENTAS ESTADÍSTICAS - RISK SIMULATOR

México D.F.

Descripción

Al finalizar el curso el participante logrará: - Desarrollar las habilidades requeridas para utilizar eficientemente la Simulación Monte-Carlo, utilizando específicamente los programas Risk Simulator y Crystal Ball - Comunicar los conceptos de riesgo al equipo de trabajo. - Comprender los beneficios de la modelación probabilística. - Construir modelos estocásticos para disminuir la incertidumbre en los sistemas. - Incorporar principios probabilísticos en la toma de decisiones. - Incorporar en el análisis de Riesgo de proyectos el enfoque de las Opciones Reales - Maximizar el uso de los recursos de la organización para maximizar el potencial de ganancia aplicando herramientas de optimización del programa Risk Simulator.

Dirigido a

Todas aquellas personas interesadas en la administración del riesgo y la incertidumbre en la toma de decisiones. Directores, gerentes, profesionales vinculados a departamentos de riesgo y docentes; relacionados con distintas ramas de la industria y el conocimiento (sector financiero, banca, minería, petróleo, construcción, servicios, etc.).

Objetivo

El curso ha sido diseñado para demostrar una amplia variedad de aplicaciones de los programas Risk Simulator. En términos de Simulación Monte-Carlo, Optimización, Aplicaciones Estadísticas y Optimización en Finanzas, Ingeniería, Administración de proyectos y otros. Al finalizar el curso el participante logrará: - Desarrollar las habilidades requeridas para utilizar eficientemente la Simulación Monte-Carlo, utilizando específicamente los programas Risk Simulator y Crystal Ball. - Comunicar los conceptos de riesgo al equipo de trabajo. - Comprender los beneficios de la modelación probabilística. - Construir modelos estocásticos para disminuir la incertidumbre en los sistemas. - Incorporar principios probabilísticos en la toma de decisiones. - Incorporar en el análisis de Riesgo de proyectos el enfoque de las Opciones Reales - Maximizar el uso de los recursos de la organización para maximizar el potencial de ganancia aplicando herramientas de optimización del programa Risk Simulator.

Temario

BASICO (8 horas) Modelos Financieros y Simulación Financiera • ¿Qué es un modelo? • ¿Para qué necesitamos construir modelos financieros? • Modelos Determinísticos Vs. Modelos Probabilísticos • ¿Qué es una simulación? • Pasos en el desarrollo de un modelo : taller práctico • Comprensión básica del riesgo y su comprensión Aproximación inicial al programa • ¿Que es Risk Simulator? • ¿Qué herramientas tiene? • Simulador Monte Carlo • Optimización • Herramientas estadísticas • ¿Qué beneficio se deriva de utilizar este producto? • ¿Cómo pueden ayudar en la gestión del riesgo? Distribuciones de Probabilidad y Estadística • Distribuciones de probabilidad • Estadísticas básicas • Distribuciones básicas • Conocer la Simulación Monte Carlo • Iniciando Risk Simulator • Terminología Básica • Navegación en la interface Preparar un modelo de

simulación • Definición de supuestos • Correlación de supuestos • Definición de pronósticos • Editar los datos
Análisis y Presentación de Resultados • Generación de reportes (Estadísticos, Generales, Datos) • Extracción
de resultados • Guardando los resultados INTERMEDIO (8 horas) Análisis de optimización y sus herramientas
• El problema de Portafolio • Características de las variables aleatorias • Características de las variables
objetivo • Características de las variables de decisión • Características del proceso de optimización •
Optimización Estática, Dinámica y Estocástica Cálculo de Opciones Financieras • Valoración neutral al Riesgo
• Movimiento Browniano • Valoración de Opciones de tipo Vanilla • Construcción y Valoración de Opciones
Exóticas • Opciones Barrera • Opciones Digitales • Opciones Asiáticas • Bull spreads Introducción a las
Opciones Reales • Enfoque clásico de valoración de proyectos Vs. Opciones reales • Opciones Reales Vs.
Opciones Financieras • Tipos de Opciones reales : diferir, abandonar, expandir, contraer • Risk Simulator y las
Opciones reales • Valoración con Opciones reales • Ejemplos prácticos de Opciones reales con Risk
Simulator

Instructores

Bernardo Leon

Acreditado con la Certificación Internacional en Manejo de Riesgo - CRM impartido por el Dr. Johnathan Mun.
Ingeniero Industrial con énfasis en Economía y Finanzas de la Universidad de los Andes. Amplia experiencia
en el Mercado de Capitales Colombiano y Americano con habilidades para diagnosticar, modelar y prospectar
económicamente la situación de los diferentes instrumentos transados en Bolsas nacionales e
internacionales. Fue representante legal de Pronta de Valores S.A., Bermudez y Valenzuela S.A., Correval
S.A., Acciones y Valores S.A., Suma Productos S.A., Suma Valores S.A., Stock Broker CLARK STREET
CAPITAL (New York), Gerente de Acciones de Acciones de Colombia S.A., director del Observatorio
Economico de la Cámara de Comercio de Bogotá, Director de la Especialización en Finanzas en la
Universidad del Rosario. Actualmente es Catedrático de la Universidad Externado, Sergio Arboleda y del
CESA.

Información General

Duración

16 horas

Fecha de Inicio

Mar. 01 de Ene de 2008

Horarios

8:00 a.m. a 5:00 p.m.

Ciudad

Ciudad de México (Distrito Federal, México)

Lugar:

SOFTWARE shop

Herramientas de apoyo



Mayores informes de inscripción y costos

Entrenamientos@Software-Shop.com

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