

Modelación y Análisis de Riesgo Con Crystal Ball® 11.1

Código: EST-107

Propuesta de Valor: ESTADÍSTICA - AUDITORIA - PLANIFICACIÓN - E-BUSINESS

Duración: 20 Horas



La búsqueda de soluciones inteligentes a los problemas que enfrentan personas y organizaciones en un contexto altamente competitivo requiere el uso de técnicas de avanzada que permitan comprender la compleja interrelación entre variables de entrada y resultados posibles a obtener. El manejo de escenarios con incertidumbre se potencia a través de la simulación, la misma que usualmente requiere el soporte de programas informáticos que permitan obtener diferentes resultados en un tiempo bastante corto.

La velocidad de cambio del mundo moderno exige capacidad de respuesta asociada con incertidumbre. En un entorno altamente volátil es fácil tomar la decisión equivocada. La simulación ofrece una vía alterna para responder con celeridad a las apremiantes necesidades de crecimiento que garanticen la sostenibilidad de la empresa. Como soporte del curso se utilizará la hoja electrónica Excel® y el software de simulación, optimización y pronósticos Crystal Ball®, líder a nivel mundial para aplicaciones que incluyen incertidumbre, variabilidad y riesgo.

AUDIENCIA

- Ejecutivos, Profesionales, Docentes y todas aquellas personas interesadas en recibir un entrenamiento especializado para desarrollar una experiencia en modelos de simulación de negocios.

PRE REQUISITOS

- El curso EST-107, no tiene requisitos.
- Pero se recomienda que conozcan tópicos de Estadísticas y Excel Básico.

OBJETIVOS

- El seminario-taller “Modelación y Análisis de Riesgos con Crystal Ball®” se orienta a desarrollar las habilidades y destrezas necesarias para crear modelos de simulación en hoja electrónica y realizar simulaciones con el programa Crystal Ball®. Su principal objetivo es mejorar el manejo de la incertidumbre con miras a incrementar la competitividad, reduciendo costos e incrementando la eficiencia y rentabilidad.
- El curso tiene como finalidad entregar a los participantes las herramientas y técnicas adecuadas para crear y experimentar con modelos de simulación de negocios, desarrollando de esta manera la capacidad de previsión indispensable para la toma de decisiones. La meta del curso es brindar las herramientas que permitan aplicar de forma

rápida e intuitiva los conceptos relacionados con la administración del riesgo a situaciones de la vida real, y de esta forma, establecer puentes entre el mundo académico y la práctica, en situaciones de la vida empresarial.

CERTIFICACIÓN DISPONIBLE

- Certificación emitida por COGNOS.

CONTENIDO

1. CONTEXTO Y CONCEPTOS: GESTIÓN INTEGRAL DE RIESGOS

- 1.1. ESTADÍSTICA
- 1.2. ESTADÍSTICA INFERENCIAL
- 1.3. TEORÍA DE PROBABILIDAD
- 1.4. DISTRIBUCIONES DE PROBABILIDAD
- 1.5. LOS RIESGOS A LOS QUE ESTA EXPUESTA LA EMPRESA
- 1.6. EL PROCESO DE ADMINISTRACIÓN DEL RIESGO

2. HERRAMIENTAS PARA ANALIZAR EL RIESGO

- 2.1. LA TOMA DE DECISIONES
- 2.2. TASA DE DESCUENTO Y RIESGO EN NEGOCIOS INTERNACIONALES
- 2.3. CARACTERIZACIÓN DE RIESGOS
- 2.4. ANÁLISIS DE RIESGOS
- 2.5. ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD Y OTROS INDICADORES
- 2.6. ARBOLES DE DECISIÓN
- 2.7. SIMULACIÓN DE MONTECARLO
- 2.8. RIESGO EN PROYECTOS DE INVERSIÓN
- 2.9. VALOR EN RIESGO

3. ANÁLISIS DE RIESGO CON CRYSTAL BALL

- 3.1. INICIÁNDOSE EN CRYSTAL BALL
- 3.2. PREPARANDO UN MODELO DE SIMULACIÓN
- 3.3. ANÁLISIS Y PRESENTACIÓN DE RESULTADOS
- 3.4. EJECUCIÓN Y CONTROL DE LA SIMULACIÓN
- 3.5. HERRAMIENTAS BÁSICAS DE CRYSTAL BALL
- 3.6. HERRAMIENTAS AVANZADAS DE CRYSTAL BALL
- 3.7. OPTQUEST: (PRÁCTICO)
- 3.8. CB PREDICTOR: (PRÁCTICO)

BENEFICIOS

- Al finalizar el curso el participante estará en capacidad de crear y experimentar con modelos de simulación, optimización y pronósticos que contribuyan a mejorar el manejo de la incertidumbre en la empresa.