



Descriptivo

Análisis de Opciones Reales dentro de la Gestión Integral de Riesgos.

Descripción:

En este webcast se ilustrará cómo un Modelo de Gestión Integral del Riesgo se puede construir usando el análisis de Opciones Reales, Simulación de Montecarlo, Pronósticos y Optimización de manera integrada.



Dirigido a:

Directivos y analistas Financieros, de Riesgos y Evaluación de Proyectos en sectores como Energía, Hidrocarburos, Gas, Minería, Banca, Seguros, Servicios Financieros, Infraestructura entre otros.



Objetivo:

- Mostrar a los participantes la importancia de las Opciones Reales dentro del proceso de Gestión Integral de Riesgos. - Entender las Opciones Reales como una herramienta para medir la flexibilidad existente en los Modelos de Incertidumbre y Medición de Riesgos.



Temario:

Conceptos Previos

- El Proceso Integral de Gestión de Riesgos.
- Simulación de Montecarlo y su importancia dentro del Análisis del Riesgo.
- Pronóstico y Optimización como herramientas de apoyo a la Simulación de Montecarlo.
- Opciones Reales: Enfoque Estratégico para la Toma de Decisiones.
- Integración de las metodologías de Simulación de Montecarlo y Opciones Reales.

Caso Práctico: Análisis Integrado de Riesgo

- ¿Qué son Risk Simulator y Real Options SLS?
- Aplicación al sector Industria

Análisis de Pronóstico

Análisis de Simulación de Montecarlo

Análisis de Opciones Reales

Análisis de Optimización Estocástica



Instructores: