



Descriptivo

Conferencia: Importancia e Inclusión de las Opciones Reales dentro de la Gestión Integral de Riesgos

Descripción:

En esta conferencia 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. Todo esto explicando cómo se pueden integrar las metodologías de análisis de riesgos a través de Simulación de Montecarlo con la metodología de Opciones Reales a fin de encontrar mayor robustez y confianza estadística de los resultados, haciendo uso para ello de los software Risk Simulator y Real Options SLS.

Dirigido a:

Directivos y Analistas Financieros, de Tesorerías, Crédito, Liquidez, Mercados, Operaciones, Evaluación de Proyectos, Costos, Presupuestos, Producción, Compras, Planeación en sectores como Energía, Hidrocarburos, Gas, Minería, Banca, Seguros, Servicios Financieros, Educación, Infraestructura en otros.

Objetivo:

1. Mostrar a los participantes la importancia de las Opciones Reales dentro del proceso de Gestión Integral de Riesgos. 2. Entender las Opciones Reales como una herramienta para medir la flexibilidad existente en los Modelos de Incertidumbre y Medición de Riesgos. 3. Proporcionar a los participantes el procedimiento para Análisis Integrado de Riesgos a través del uso de herramientas especializadas como Risk Simulator y Real Options.

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: