

# Taller

## Taller Didáctico Presencial Análisis de Riesgos en la Evaluación de Proyectos de Inversión usando Risk Simulator

### Descripción

El taller aborda desde un enfoque sencillo y práctico los diferentes tipos de riesgo existentes en un proyecto de inversión dando al participante herramientas básicas que le permitirán iniciar el mundo del manejo del riesgo. Los participantes podrán interactuar con el software Risk Simulator que les permitirá cuantificar el riesgo y servir de herramienta en la toma de decisiones de inversión. Al finalizar el taller, los participantes habrán sido expuestos a los conceptos elementales y las técnicas que son pre-requisitos necesarios para llevar a cabo un análisis de riesgo y para tomar decisiones de inversión adecuadas utilizando el software de Risk Simulator.

### Dirigido a

Esta presentación está dirigida a personas interesadas en temas de control y modelación de riesgo que deseen una primera introducción a la metodología de análisis de riesgos aplicados a proyectos de Inversión.

### Objetivo

El Objetivo primordial del taller es llevar al participante por las principales metodologías teóricas desde un enfoque práctico, para que pueda tener una contextualización en el manejo, modelación y medición del riesgo en evaluación de proyectos de inversión.

### Temario

1. ¿Qué es un Proyecto de Inversión?
2. Evaluación de Proyectos
  - 2.1. Evaluación Social de Proyectos
  - 2.2. Evaluación Privada de Proyectos
3. Criterios de Evaluación de Proyectos
4. Análisis de Riesgo por simulación
  - 4.1. Método de simulación de Montecarlo
5. Empezando a usar el Risk Simulator
  - 5.1. Ejemplo de Evaluación de Proyectos
  - 5.2. Diversificación del Riesgo en Proyectos
  - 5.3. Uso de la Optimización en Risk Simulator para evaluar Proyectos de Inversión usando Risk Simulator

### Instructores

## **Fernando Jáuregui Puertas**

Acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgos CRM, impartida con el Dr. Jonathan Mun. Profesional en Ciencias Económicas de la Universidad Nacional de Ingeniería del Perú. Executive Master in Financial Analysis en la Universidad Carlos III de Madrid (España). Adicionalmente, cuenta con especialización en Gestión de Riesgos Financieros en BURSEN (Centro de Estudios Bursátiles de la Bolsa de Valores de Lima) y en Formulación y Evaluación de Proyectos de Inversión Pública en la Universidad ESAN. Actualmente es docente de la Maestría en Finanzas de la Universidad del Pacífico (Perú) e instructor de SOFTWARE shop para LATAM. Tiene experiencia en el sector público como Analista de Proyectos de Inversión y en el Sector Bancario como Analista de Estudios Económicos. Anteriormente se desempeñó como docente de la Facultad de Ingeniería Económica de la Universidad Nacional de Ingeniería (Perú), en las asignaturas de Econometría II y Análisis de Series Temporales.

## **Información General**

### **Duración**

2 horas

### **Fecha de Inicio**

Vie. 04 de Nov de 2011

### **Horarios**

11:30 a.m. a 1:30 p.m.

### **Ciudad**

Lima (Lima, Perú)

### **Lugar:**

Universidad ESAN Laboratorio 12

**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