Entrenamiento Especializado

Evaluación de Proyectos de Inversión - Simulación de Monte Carlo, Optimización, Pronóstico y Opciones Reales.

Descripción

En este entrenamiento se mostrará la metodología para realizar un Análisis Integrado de Riesgos en la Evaluación de Decisiones de Inversión considerando herramientas para Medición y Evaluación de Incertidumbre y flexibilidad dentro de los proyectos que presentan las organizaciones.

Dirigido a

Directivos, Analistas Financieros, Analistas en Evaluación de Proyectos, Costos, Presupuestos, Producción, Planeación en sectores como Energía, Hidrocarburos, Gas, Transporte, Infraestructura Telecomunicaciones y Minería.

Objetivo

- Mostrar a los participantes el proceso de Gestión Integral de Riesgos dentro de un Proyecto de Inversión.
- Entender la Simulación de Montecarlo como Metodología para la Modelación de Incertidumbre en las Decisiones de Inversión.

Temario

Fundamentos Estadísticos para el manejo de Modelos de Riesgo

Estadística Descriptiva
Probabilidad y Variables Aleatorias
Teorema del Límite Central
Enfoque Estadístico de la Simulación de Monte Carlo

Aproximaciones para manejar Incertidumbre

Estimación de Punto Único
Análisis de Escenarios Análisis de Situaciones "Y Si"
Aproximación de Simulación
a. Criterios de Evaluación de Inversiones
Cálculo del Valor Actual Neto (VAN)
Criterios de la Tasa Interna de Retorno (TIR)
Cálculo del Costo de Oportunidad de Capital
Cálculo de TIR Modificada
b. Análisis de Sensibilidad de Proyectos
Análisis de Sensibilidad Estático: Análisis Tornado y Araña
Análisis de Sensibilidad Dinámico: Coeficiente de Correlación no Lineal y Contribución de Varianza
Análisis de Escenarios

Modelando Incertidumbre a través de la Simulación de Monte Carlo
Análisis de Simulación de Monte Carlo
Correlacionar y Truncar Distribuciones de Probabilidad
Alterna Parámetros y Simulaciones Multidimensionales
Ajuste de Distribución Simple y Múltiple con Información Histórica
Ajuste de Distribución Personalizada
Comparación de Proyectos utilizando Gráficos Sobrepuestos
Calcular la volatilidad de un proyecto de inversión a partir del enfoque del retorno logarítmico del flujo de caja

Pronósticos de Variables Relevantes
Análisis de Regresión Simple y Múltiple
Pronóstico de Series de Tiempo
Metodología Box-Jenkins (ARIMA)

Determinación Dinámica de la Tasa de Descuento en un Proyecto de Inversión
El Rendimiento Mínimo Esperado y su Relación con el Flujo de Caja Libre
Costo de la Deuda y Costo del Patrimonio
Cálculo del Costo de Capital utilizando del Modelo CAPM cuando cotiza y no cotiza en Bolsa.

Proceso de Optimización para la Selección de Inversiones
Optimización Continua
Optimización Discreta
Optimización Entera

Árboles de Decisión
¿Qué es un Árbol de Decisión?
Elementos de un Árbol de Decisión
Valor Monetario Esperado
Ajuste de Distribución de Probabilidad
Análisis de Escenarios

Opciones Reales
¿Qué son las Opciones Reales?
Comparación entre Opciones Financieras y Reales
Variables que determinan el Precio de una Opción Real

Metodologías para el Cálculo de la Opción
Black-Scholes
Simulación de Monte Carlo
Árboles Binomiales

Instructores

Miguel Ángel Bello Bernal, Mag.

Economista de la Universidad de la Salle y MBA de la Universidad Villanueva en España. Actualmente, está acreditado con la Certificación Internacional en Gestión de Riesgos-CQRM impartida por el Dr. Johnathan Mun. Consultor y formador especialista en Software Shop. Profesor de estadística, econometría y analitica de datos, a nivel de pregrado y posgrado en el Colegio de Estudios Superiores de Administración (CESA) y otras universidades de Colombia. Cuenta con 7 años de experiencia como conferencista y capacitador internacional

en análisis de riesgo y métodos cuantitativos para mejorar la toma de decisiones bajo escenarios de incertidumbre.

Información General

Duración
16

Fecha de Inicio
Jue. 31 de Dic de 2020

Horarios
Fechas:
Noviembre 27, 28, 29 y 30 de 2017

Horarios:
De 2:00 a 18:00

Ciudad:
Quito, Ecuador

Ciudad
Quito (Pichincha, Ecuador)

Lugar:
Escuela Politécnica Nacional

Herramientas de apoyo

Risk Simulator

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