

Entrenamiento Especializado

Evaluación Económica 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

Alternar 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 el 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

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 analítica 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 horas

Fecha de Inicio

Lun. 12 de Jun de 2017

Horarios

Fecha:

Junio 12 al 15 de 2017

De:

5:00 p.m. a 9:00 p.m

Lugar:

Universidad Anáhuac

Campus Norte

Sala Didáctica Híbrido 2

Edificio Biblioteca Segundo Piso

Ciudad de México

Ciudad

Ciudad de México (Distrito Federal, México)

Lugar:

Universidad Anáhuac

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