

ANÁLISIS DE RIESGOS DEL PROYECTO - UAI

Incorporando la incertidumbre en la toma de decisiones de proyectos

DESCRIPCIÓN

El tratamiento de la incertidumbre es esencial para la preparación de un proyecto de inversión, ya que la asignación del riesgo entre las distintas partes interesadas es de suma importancia para la viabilidad del acuerdo. El análisis de los riesgos financieros del proyecto es un insumo fundamental para una correcta evaluación integrada de un proyecto de inversión, y tiene como objetivo identificar las variables que impactan en los resultados financieros y económicos de una inversión. Ello, mediante la medición del impacto en los indicadores de rentabilidad y bancabilidad que tiene la incertidumbre, considerando que se desconocen los verdaderos valores que tomarán los distintos datos de entrada que contiene la modelación estática.

En este curso se desarrollan aspectos como la identificación de los factores de incertidumbre que impactan en los indicadores mediante el análisis de sensibilidad, las técnicas para realizar analíticamente una modelación del riesgo del proyecto, y las herramientas para transformar dichos resultados en recomendaciones y planes de acción.

¿A QUIÉN ESTÁ DIRIGIDO?

Este curso está dirigido a técnicos, profesionales, empresarios, financistas y bancarios, ejecutivos del sector privado y empresas públicas; funcionarios de agencias gubernamentales, consultores, asesores, académicos y docentes, interesados en comprender la lógica del análisis integrado de proyectos y de cómo éste se relaciona con los procesos de diseño, selección y financiamiento de proyectos.

OBJETIVOS DE APRENDIZAJE

Finalizado este curso, se espera que los y las participantes sean capaces de identificar los factores de riesgo de un proyecto de inversión; determinar las técnicas apropiadas de acuerdo al contexto y naturaleza del proyecto; realizar análisis computacionales aplicando la técnica de Simulación Montecarlo y obtener distribuciones de probabilidad de los indicadores de rentabilidad del proyecto para tomar decisiones o realizar recomendaciones a partir de estos.

CONTENIDOS DEL CURSO

Unidad 1: Fuentes y naturaleza de la variabilidad de un proyecto

Unidad 2: Técnicas de evaluación de riesgo; árboles de decisión

Unidad 3: Técnicas de evaluación de riesgo; análisis de sensibilidad

Unidad 4: Técnicas de evaluación de riesgo; análisis de escenarios

Unidad 5: Técnicas de evaluación de riesgo; simulación de Monte Carlo

Unidad 6: Parametrización de las variables de riesgo; gestión de riesgo

Unidad 7: Evaluación de contratos

Unidad 8: Modelos de Project Finance aplicado a los proyectos

CUERPO DOCENTE



Eduardo Koffmann

Ing. Civil Industrial y Magíster en Ciencias de la Ing. (PUC); Diplomado en Preparación y Evaluación Social de Proyectos (U. de Chile). Postgrado en Project Appraisal and Risk Analysis en Queen's, Canadá. PMP Certificado. Prof. Adjunto del Curso Evaluación Social de Proyectos en la Facultad de Ingeniería de la Universidad Católica de Chile. Trabajó como especialista en metodologías de Evaluación de Proyectos de Transporte en el Sistema Nacional de Inversiones, y como Coordinador Nacional de Planificación y Desarrollo en el Ministerio de Transporte y Telecomunicaciones.