

PLANEAMIENTO BAJO INCERTIDUMBRE CON @RISK Y DECISIONTOOL

Objetivos de Aprendizaje

- › Describir eficientemente los modelos de simulación con @Risk
- › Aplicar modelos de sensibilidad "que pasaría si" con TopRank aplicado al flujo de caja
- › Establecer modelos relacionales para proyectar y predecir de datos con StatTools
- › Aplicar modelos con redes neuronales a través de NeuralTools
- › Realizar un análisis de sensibilidad con Evolver y RiskOptimizer
- › Preparar y analizar un modelado de árbol de decisiones con PrecisionTree

Sesión 01 Simulaciones con @Risk

- › Descripción del entorno del @Risk.
- › Elaboración de un modelo de sensibilidad.
- › Identificación de variables de ingreso y salida del modelo.
- › Tipos de distribuciones de probabilidad.
- › Asignación de distribuciones a las variables
- › Determinar y analizar las probabilidades de ocurrencia del evento
- › Caso de sensibilidad en un flujo de caja
- › Caso de sensibilidad de una cartera de inversiones con @Risk
- › Caso de determinar el valor en riesgo de un portafolio

Sesión 02 Modelo de sensibilidad con TopRank

- › El pronóstico financiero
- › Elaboración del flujo de caja
- › Flujo de caja económico y financiero
- › Criterios de rentabilidad
- › Identificación de variables sensibles con autovary
- › Gráficos de tornado y Spider
- › Caso de análisis de elasticidad en la variable dependiente
- › Caso de sensibilidad identificando las variables de un flujo de caja

Sesión 03 Proyectar y predecir de datos con StatTools

- › Análisis estadístico descriptivo.
- › Matriz de correlación.
- › Análisis de autocorrelación.
- › Análisis y proyección de variables con regresión múltiple
- › Regresión logística identificando las probabilidades del evento.
- › Caso de predicción de variables como ventas, costos y precios.
- › Caso de análisis de eficiencia de mercado tabla dinámica y StatTools

Sesión 04 Análisis de redes neuronales con NeuralTools

- › Utilización de la metodología de redes neuronales.
- › Entrenamiento de la red.
- › Análisis de data mining con NeuralTools
- › Testeo de muestra aleatoria.
- › Caso predicción de riesgo de créditos con NeuralTools
- › Caso predicción del precio de la energía y petróleo

Sesión 05 Análisis de sensibilidad con Evolver y RiskOptimizer

- › Solver para maximizar el beneficio
- › Definición de las celdas ajustables
- › Ejecución de la optimización
- › Reporte de sensibilidad de @risk
- › Análisis de riesgos con RiskOptimizer
- › Ejecutar el modelo de rendimiento de un portafolio de activos con RiskOptimizer
- › Caso de optimización de un portafolio con Evolver
- › Caso selección de producción en un sistema de costos
- › Caso de escenarios con RiskOptimizer

Sesión 06 Opciones financieras con PrecisionTree

- › Uso de distribuciones de probabilidad
- › Probabilidad condicional y diagrama del árbol
- › Caso de Selección de un portafolio
- › Caso de Exploración y Producción con PrecisionTree
- › Caso en la elaboración de un modelado de decisiones

INFORMES E INSCRIPCIONES

✉ extension@ue.edu.pe

🌐 <https://www.ue.edu.pe/programa-de-extension-universitaria-cursos-y-talleres>

📍 UNIVERSIDAD ESAN | Av. Alonso de Molina 1652, Surco, Lima - Perú