

Finanzas Aplicadas con MS Excel y @Risk

El curso proporciona al participante la habilidad básica para elaborar modelos de sensibilidad financieros, con el uso de la herramienta de @ RISK, que le permita tomar la mejor decisión ante los diversos escenarios planteados.

DETALLES DEL EVENTO:

Fecha:	30 de junio	todos los dom. de 15:00 h a 18:40 h
Duración:	24 horas académicas	(06 sesiones de 04 h c/u)

*Duración de la hora académica: 50 minutos

Objetivos de aprendizaje:

Describir eficientemente un Modelo de sensibilidad con el programa @Risk.

Elaborar modelos aplicados a establecer la capacidad de endeudamiento para obtener un crédito, valorización de Bonos y Acciones.

Interpretar adecuadamente los reportes como histogramas, gráficas y reportes estadísticos.

Maximizar una cartera de inversiones con el uso de RiskOptimizer.

Implementar un modelo de calificación de una cartera de créditos a través de la metodología de redes neuronales.

Identificar las variables de mayor sensibilidad en un flujo de caja que puedan tener mayor impacto en su resultado a través de la herramienta TopRank

Elaborar modelos de regresión para seleccionar el mejor modelo predictivo a través de StatTools.

Metodología:

El curso se desarrollará en un laboratorio de cómputo utilizando el software @RISK.

Exposición del docente a través de presentación de diapositivas y casos prácticos.

Discusión de casos y realización de ejercicios prácticos.

Discusión de lecturas que el alumno deberá revisar en cada sesión.

Exposiciones interactivas del profesor y de los alumnos con material de apoyo y ejemplos.

Las evaluaciones son totalmente prácticas (Laboratorios Calificados), sobre aplicación de los temas dictados con los modelos de datos.

Temario:

El entorno del @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.
- Determinando el número de interacciones y ejecutar la simulación.
- Modelo de capacidad de endeudamiento en la evaluación de créditos.
- Modelo de Valorización de Bonos.

Análisis de resultados del modelo.

- Histograma y curvas cumulativas.
- Gráfico de tornado.
- Diagramas de dispersión.
- Gráficos de resultados superpuestos.
- Ventana de resultados resumen. Análisis de variables económicas y financieras con histogramas.
- Modelo de Valorización de Acciones.

RiskOptimizer.

- Definición de la incertidumbre.
- Definición del objetivo.
- Definición de las celdas ajustables.
- Definición de las limitaciones.
- Ejecución de la optimización.
- Resultados de la optimización.
- Análisis del máximo rendimiento de una cartera de activos.

NeuralTools.

- Utilización de la metodología de redes neuronales.
- Entrenamiento de la red.
- Testeo de muestra aleatoria.
- Tipos de predicción.
- Simulación de evaluación de créditos con información histórica.

TopRank.

- Definición de variables de salida.
- Utilización de funciones autovariables.
- Análisis de estrés determinístico.
- Configuración del análisis.
- Gráfico de tornado.
- Gráfico Spider.
- Elaboración de presupuestos.
- Elaboración de un flujo de caja sensible.
- Criterios de rentabilidad de inversiones.

StatTools.

- Análisis estadístico.
- Matriz de correlación.
- Análisis de autocorrelación.
- Análisis de regresión y series de tiempo.
- Regresión logística.
- Predicción de variables como ventas y costos.
- Establecer el mejor modelo de regresión que permita predecir la variable dependiente.

Dirigido a:

Profesionales o estudiantes interesados en mejorar la toma de decisiones a través de una comprensión del riesgo inherente a cada acción, así como en realizar pronósticos y optimizar los recursos empresariales para maximizar la rentabilidad. Interesados en desarrollar modelos de sensibilidad financiera que les permita tomar una adecuada decisión. Requiere conocimientos de Excel básico y de conceptos de fundamentos de finanzas.

Inversión:

Público en general: S/ 588.00
Pago por anticipado (hasta el 18 de mayo): S/ 529.20
Ex alumnos de pregrado, alumnos de posgrado y del DPA de la Universidad ESAN: S/ 529.20
Club El Comercio: S/ 499.80
Alumnos de pregrado de la Universidad ESAN: S/ 470.40
Corporativo (05 a más inscritos): S/ 470.40

*Se requiere un mínimo de 08 alumnos para iniciar el curso.

*Se entregará Certificado de Aprobación y Constancia de Nota a nombre de la Universidad ESAN.

*Una vez iniciado el curso no hay lugar a retiros, ni devoluciones.

Profesor:

Valentín Calderón Contreras

Profesor contratado a tiempo parcial de la Universidad ESAN.

Magister en Finanzas por la Universidad ESAN.

Economista con experiencia en el sistema financiero como funcionario en la banca y expositor en diversos cursos de capacitación dictado a Bancos, Cajas Municipales de Ahorro y Crédito, Financieras, Edpymes y otras instituciones financieras.

Docente en finanzas y tecnologías de información para finanzas en instituciones de prestigio.

Asesor - Consultor de Empresas.

Informes e inscripciones:

Universidad ESAN

Oficina de Admisión Pregrado

lun. - vie. de 09:30 h a 19:45 h | sáb. de 09:00 h a 12:45 h

T. 712 7272 | extension@ue.edu.pe

<https://www.ue.edu.pe/programa-extension-universitaria>

Alonso de Molina 1652, Monterrico, Surco

SI ERES
SUSCRIPTOR
OBTÉN

15%
dscto.

Club 