

GS Grupo Stanley®

Manual del usuario

Solución analítica para la Mesa de Dinero

- Contenido:
- 1 Introducción
- 1.1 Propósito del Manual
- 1.2 Requisitos del sistema
- 2.1 Predicción financiera de acciones
- 2.2 Resumen de la solución analítica
- 2.3 Descripción general del modelo
- 3.1 Introducción a Power BI
- 3.2 Componentes del tablero de control
- 3.3 Instrucciones de uso del tablero
- 3.4 Interpretación de gráficas financieras

- 1.1 Propósito del Manual
- Este manual de usuario proporciona instrucciones para los analistas de la Mesa de Dinero del Grupo Stanley® sobre cómo utilizar la solución analítica para la toma de decisiones sobre acciones financieras. Su objetivo es ayudar a los usuarios a comprender, evaluar los resultados e implementar la solución.
- 1.2 Requisitos del sistema
- Computador con un sistema operativo Windows, macOS o Linux. Teléfono inteligente o tableta.
- Recurso computacional suficiente y acceso a internet.
- No requiere instalación ni entornos de programación.

- 2.1 Predicción financiera de acciones
- El mercado de valores es volátil con una serie de factores relacionados a la incertidumbre, como la inflación, tasas de interés y factores políticos. El índice S&P 500 es una referencia del rendimiento del mercado, por lo cual puede fluctuar entre días.
- 2.2 Resumen de la solución analítica
- Visualizar el índice S&P500, indicadores económicos que influyen en su variación, encontrar relaciones y construcción de un modelo de predicción.
- 2.3 Descripción general del modelo
- DeepVAR (multivariate time-series forecasting) que nos permite predecir todas las series de tiempo con un solo modelo considerando las relaciones entre ellas.

- 3.1 Introducción a Power BI
- Referencia: <https://learn.microsoft.com/en-us/power-bi/fundamentals/power-bi-overview>

Power BI es un servicio de software para el tratamiento visual de datos y el descubrimiento de información. La solución analítica para la Mesa de Dinero del Grupo Stanley utiliza el componente Power BI Report Server, como servicio de informes.



- 3.2 Componentes del tablero de control
- El tablero de control desarrollado tiene como objetivo apoyar la toma de decisiones por parte de la Mesa de Dinero del Grupo Stanley al contar con visualizaciones de: 1. Comportamiento histórico y 2. Predicción confiable a corto plazo (de uno a siete días) del S&P500 y variables de interés.



- 3.3 Instrucciones de uso del tablero
- Diariamente, antes del horario de apertura del mercado colombiano (7:00 am), se cargan automáticamente en la nube los datos históricos y la predicción del S&P500 al último día hábil anterior.
- Para acceder a los datos más actualizados es necesario actualizar la consulta dando clic en "Actualizar", en la pestaña "Inicio".
- Para visualizar el comportamiento del S&P500 y variables de interés, ir a la pestaña “Principal”:

Seleccionar el intervalo de confianza que se desea observar en el filtro “Intervalo de confianza”. Por defecto muestra el intervalo de confianza correspondiente al 99%.

Para observar únicamente la predicción, seleccionar únicamente uno de los cuatro intervalos de confianza. Para observar la predicción acompañada de los datos históricos, seleccionar uno de los intervalos de confianza y la opción “observado” (Ctrl+ clic).



- Para visualizar relaciones relevantes en el comportamiento del S&P500 y otras variables, ir a la pestaña "Correlaciones":
- Si se desea observar la relación entre variables del mercado bursátil, se debe:
- Hacer clic sobre el botón “Mercado bursátil” que se encuentra en la esquina superior izquierda (clic en la versión pública o Ctrl+clic en la versión de escritorio).
- Seleccionar las acciones o variables que se desea observar en los filtros “Activo1” y “Activo2”.
- Deslizar el filtro de fecha hasta seleccionar la ventana de tiempo que se desea.

- Si se desea observar el comportamiento histórico para una variable específica en una ventana de tiempo determinada, se debe:
- Hacer clic sobre el botón “Histórico” que se encuentra en la esquina superior izquierda (clic en la versión pública o Ctrl+clic en la versión de escritorio).
- Seleccionar la acción o variable que se desea observar en el filtro “Activo”
- Deslizar el filtro de fecha hasta la ventana de tiempo que se desea.
- Si se desea observar la predicción para una variable específica en una ventana de tiempo determinada para cierto intervalo de confianza, se debe:

- Hacer clic sobre el botón “Predicciones” que se encuentra en la esquina superior izquierda (clic en la versión pública o Ctrl+clic en la versión de escritorio).
- Seleccionar la acción o variable que se desea observar en el filtro “Activo”. Deslizar el filtro de fecha hasta la ventana de tiempo que se desea.
- Para observar únicamente la predicción, seleccionar únicamente uno de los cuatro intervalos de confianza.
- Para observar la predicción acompañada de los datos históricos, seleccionar uno de los intervalos de confianza y la opción “observado” (Ctrl+ clic).

- Si se desea observar la relación entre variables del mercado bursátil y variables de macroeconómicas, se debe
- Hacer clic sobre el botón “Variables macroeconómicas” que se encuentra en la esquina superior izquierda (clic en la versión pública o Ctrl+clic en la versión de escritorio).
- Seleccionar las acciones o variables que se desea observar en los filtros “Activo1” y “Variable2”.
- Deslizar el filtro de fecha hasta seleccionar la ventana de tiempo que se desea.

- 3.4 Interpretación de gráficas financieras
- Candlestick: esta conformado por un cuerpo, sombra y un color. El cuerpo representa el rango de precios de apertura y cierre de negociación del día. La sombra indica el mínimo y máximo del día y el color la dirección del movimiento del mercado, verde un aumento y rojo una disminución.

