Webcast

Sesión II: Procesos Estocásticos en las Finanzas

Descripción

Bajo esta sesión de procesos estocásticos se pretende dar al participante las bases de los diferentes tipos de procesos, su presentación a partir del análisis y la modelización de fenómenos aleatorios. Así mismo, se explicarán los dos estadísticos fundamentales para la obtención de distribuciones de probabilidad de las series de datos: Test de Kolmogorov Smirnov y Test de Anderson Darling. Finalmente, se hará énfasis en otros procesos discretos y se culminará la sesión con movimientos brownianos y simulaciones en tiempo continuo.

Dirigido a

Esta introducción y formalización está dirigida a profesionales, participantes del sistema financiero, estudiantes y académicos en las ramas económicas, finanzas, administrativas, estadísticas y de ingeniería, las cuales tengan la intención de fortalecer los conocimientos propios a los procesos estocásticos desde sus bases junto con su carácter aplicado a las finanzas.

Objetivo

- Brindar a los participantes una clara explicación de los procesos estocásticos.
- Explicar ampliamente las demostraciones matemáticas de los teoremas, definiciones, propiedades y argumentos más importantes.
- Realizar ejercicios prácticos con el fin de aplicar los conceptos explicados

Temario

1. Definiciones.
2. Procesos estocásticos en las finanzas.
3. Estadístico de Kolmogorov Smirnov.
4. Estadístico de Anderson Darling.
5. Procesos estrictamente estacionarios.
6. Cadenas de Markov.
7. Procesos de Poisson.
8. Martingalas.
9. Paseo Aleatorio Movimiento Browniano.

Instructores

Sergio Andrés Matiz Velandia

Profesional en Finanzas y Comercio Internacional, egresado de la Universidad de La Salle en Colombia, con énfasis en mercado de capitales. Actualmente adelanta estudios de Maestría en Banca y Finanzas Cuantitativas en la Universidad del País Vasco. Amplio conocimiento en los campos de microeconomía, teoría de juegos y análisis estadístico de datos, portafolios de inversión, valoración de los mismos, administrador de riesgos, análisis de mercados bursátiles y estructuración de instrumentos derivados.

Información General

Duración

1 Hora

Fecha de Inicio

Vie. 13 de Oct de 2017

Horarios

San José de Costa Rica 9:00 a.m
México D.F. 10:00 a.m
Bogotá 10:00 a.m
Quito 10:00 a.m
Lima 10:00 a.m
Caracas 11:00 a.m
Bolivia 11:00 a.m
Santiago 12:00 m
Buenos Aires 12:00 m

Herramientas de apoyo

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