Webcast

Realización de Procesos Estocásticos: Movimiento Browniano Estándar y Geométrico en 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 el modelado de fenómenos aleatorios. Así mismo, se hará énfasis en conocer en detalle las bases teóricas, culminando la sesión con Movimientos Brownianos y simulaciones en tiempo continuo para opciones financieras.

Dirigido a

Profesionales, participantes del sistema financiero, estudiantes y académicos que estén en las áreas de economía, administración, estadística e ingeniería, y en general a cualquier persona que tenga interés en la aplicación de procesos estocásticos en la valoración de activos financieros.

Objetivo

- Detallar las bases teóricas de los modelos estocásticas e integrales de Îto.
- Conocer las propiedades básicas de cada Movimiento Browniano.
- Brindar herramientas de construcción y análisis para el pronóstico del precios de los activos financieros.

Temario

1. Definiciones
2. Paseo Aleatorio
3. Proceso Browniano / Wienner
4. Propiedades Movimiento Browniano
5. Propiedades Movimiento Browniano Geométrico
6. Simulación

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
Jue. 23 de Nov de 2017

Horarios
San José de Costa Rica 1:00 p.m
México D.F. 1:00 p.m
Bogotá 2:00 p.m
Quito 2:00 p.m
Lima 2:00 p.m
Caracas 3:00 p.m
Bolivia 3:00 p.m
Buenos Aires 4:00 p.m
Santiago de Chile: 4:00 pm

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