Webcast

Técnicas de Estimación de Volatilidad en Finanzas

Descripción

La posibilidad de tener varias estimaciones de volatilidad hace que sea muy difícil identificar la más adecuada. En este webinar se darán a conocer las principales claves para conocer, analizar y cuantificar la volatilidad dependiendo del objetivo del analista y de los datos que se tienen.
 Para aquellos que no pudieron asistir a la primera sesión, a continuación, encontrarán el enlace para la visualización del video: https://www.software-shop.com/contenido/video/4114

Dirigido a

Profesionales, estudiantes y personas que estén interesadas en mejorar sus conocimientos, capacidades y habilidades para una adecuada toma de decisiones involucrando la volatilidad y la Simulación de Monte Carlo como herramienta de apoyo.

Objetivo

- Determinar cuál es la mejor manera de calcular volatilidad con información histórica.
- Utilizar software especializado para llevar a cabo procedimientos robustos en finanzas.

Temario

1. ¿Cuál es la diferencia entre Riesgo e Incertidumbre?

2. ¿Por qué es importante valorar el Riesgo?

3. Algunas estimaciones de Volatilidad:

a. Aproximación del Coeficiente de Variación.
b. Aproximación del Retorno Logarítmico del Flujo de Caja.
c. Aproximación del Retorno de los Activos: Volatilidad Histórica vs Volatilidad Dinámica.
d. Enfoque de Probabilidad.
e. Modelos de Volatilidad Condicional: ARCH (q), GARCH (p,q).

5. Sesión de preguntas y respuestas

Instructores

Miguel Ángel Bello Bernal

Economista de la Universidad de la Salle y MBA de la Universidad Villanueva en España. Actualmente, está acreditado con la Certificación Internacional en Gestión de Riesgos-CQRM impartida por el Dr. Johnathan Mun. Consultor y formador especialista en Software Shop. Profesor de estadística, econometría y analitica de datos, a nivel de pregrado y posgrado en el Colegio de Estudios Superiores de Administración (CESA) y otras universidades de Colombia. Cuenta con 7 años de experiencia como conferencista y capacitador internacional

en análisis de riesgo y métodos cuantitativos para mejorar la toma de decisiones bajo escenarios de incertidumbre.

Información General

Duración

1 Hora

Fecha de Inicio

Jue. 03 de May de 2018

Horarios

San José de Costa Rica 10:00 a.m
México D.F. 11:00 a.m
Bogotá 11:00 a.m
Quito 11:00 a.m
Lima 11:00 a.m
Caracas 12:00 m
Bolivia 12:00 m
Santiago 1:00 p.m
Buenos Aires 1:00 p.m

Herramientas de apoyo

Risk Simulator

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