

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. <div>
</div><div>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</div>

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, Mag.

Economista de la Universidad de la Salle, Magíster en Administración y Dirección de Empresas de la Universidad Villanueva en Madrid-España y acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgo - CQRM, impartida por el Dr. Johnathan Mun y otorgada por el Instituto IIPER. Actualmente, es consultor y docente en el Colegio de Estudios Superiores de Administración (CESA), además, se ha desempeñado como docente y director de tesis de maestría en diferentes universidades de la región así como expositor internacional e instructor especializado en temas de riesgo y finanzas como parte del equipo de instructores de Software Shop para Latinoamérica.

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



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