

# Webcast

## Sesión II: 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 analítica 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. 02 de Ago de 2018

### Horarios

10:00 a.m San José de Costa Rica

11:00 a.m CDMX - Bogotá - Quito - Lima

12:00 a.m La Paz - Santiago - Caracas

01:00 p.m Buenos Aires

### 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