

# Webcast

## Aplicación de los Métodos Cuantitativos en la toma de Decisiones Financieras.

### Descripción

En esta presentación se abarcará desde un enfoque teórico y práctico la manera con que se pueden utilizar los métodos cuantitativos en las finanzas. Al iniciar la sesión, se resumirán los principales hechos estilizados sobre los rendimientos financieros y se validará la pertinencia de utilizar técnicas estadísticas y econométricas para encontrar la dependencia y causalidad entre variables financieras. Al finalizar la intervención, se tendrá una sesión de preguntas y respuestas por parte de los asistentes.

### Dirigido a

Analistas, consultores, gerentes financieros y de riesgos, estudiantes de disciplinas financieras, económicas e ingenierías, especialistas en finanzas, y en general aquellas personas interesadas en conocer y aplicar los métodos de investigación cuantitativa en finanzas.

### Objetivo

Aplicar herramientas y técnicas cuantitativas para el análisis en la toma de decisiones bajo incertidumbre.

### Temario

1. Principales métodos de investigación cuantitativa en finanzas.
2. Modelos Teóricos en Finanzas
  - a. Portafolios de Inversión.
  - b. CAPM y APT.
3. Principales hechos estilizados sobre los rendimientos en finanzas.
  - a. No normalidad.
  - b. Caminata aleatoria con autosimilitud.
  - c. Aglomeración de volatilidad.
  - d. Normalidad Agregada.
  - e. Efectos de Apalancamiento.
  - f. Dependencia y autocorrelación
4. Dependencia y causalidad estadística: Correlación Cruzada y Causalidad de Granger.
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. 09 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