

Webcast

Análisis Estadístico del Comportamiento del Retorno de las Acciones

Descripción

Presentación vía web donde se mostrará las principales herramientas analíticas aplicadas para la interpretación, el análisis y la proyección de precios y retornos de los activos financieros. Inicialmente, se abordarán los conceptos básicos de estadística y finanzas para introducir al participante en la temática, para que posteriormente se apliquen herramientas como la Simulación de Monte Carlo y Bootstrap para la proyección de variables.

Dirigido a

Analistas financieros, gerentes financieros y de riesgos, consultores financieros, analistas de riesgo, docentes universitarios, estudiantes de disciplinas financieras y económicas, especialistas en finanzas, y en general todas aquellas personas interesadas conocer las principales aplicaciones de la estadística y las distribuciones de probabilidad en el análisis del retorno de las acciones.

Objetivo

- Describir los hechos estilizados que se presentan en los activos financieros.
- Conocer las aplicaciones de herramientas analíticas en el análisis de los retornos de las acciones.

Temario

1. Hechos estilizados en los activos financieros.
2. Principales conceptos:
 - Retorno y Riesgo.
 - Prima de Riesgo.
 - Retorno requerido sobre acciones.
 - Costo Promedio Ponderado de Capital: WACC
3. Retornos Continuos y Discretos.
4. Principales funciones de distribución de probabilidad y momentos de una Distribución.
- 5 Simulaciones de Monte Carlo y Bootstrap aplicado a Retornos.
6. Introducción a Procesos Estocástico y Series de Tiempo para la proyección de precios.

Instructores

Franco Andrés Mansilla Ibañez

Especialista en entrega de soluciones analíticas a necesidades y problemáticas del negocio, tal como inversiones, operaciones y riesgos. Académico de la Universidad de Chile en cursos de Riesgo Financiero del Magíster en Finanzas y Métodos Cuantitativo en la gestión de riesgo en el diplomado de Administración de

Riesgo. Sus temas de investigación son: eficiencia de mercado, riesgo financiero, machine learning y econometría.

Información General

Duración

1 hora

Fecha de Inicio

Vie. 26 de Oct de 2018

Horarios

08:00 a.m San José de Costa Rica

09:00 a.m CDMX - Bogotá - Quito - Lima

10:00 a.m La Paz - Caracas

11:00 a.m Buenos Aires - Santiago de Chile

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