

Webcast

Modelos de Volatilidad Condicional con EViews

Descripción

Presentación vía web que abarca desde un enfoque sencillo y práctico las principales metodologías para calcular la volatilidad de activos financieros y su aplicación en el cálculo del valor en riesgo paramétrico (VaR) con el software EViews.

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 en conocer los principales modelos de series de tiempo en EViews.

Objetivo

1. Conocer los conceptos de Volatilidad Histórica y Volatilidad Condicional aplicados a los retornos de los activos financieros.
2. Aprender a calcular la varianza de activos financieros con diferentes

Temario

1. Importancia de la medición de la volatilidad en activos financieros.
2. Teoría y práctica de volatilidad histórica.
3. Teoría y práctica de volatilidad condicional: ARCH, GARCH y TGARCH.
4. Aplicación en series financieras y cálculos de Valor en Riesgo.

Instructores

Franco Andrés Mansilla Ibañez

Ingeniero Civil Industrial con Magister en Finanzas en la Universidad de Chile. Actualmente, se encuentra trabajando como Analista Gestión de Riesgo Senior del Banco Santander en Chile. Se ha desempeñado como Analista en Investigación Económica y Financiera para académicos de la Universidad de Chile y Banco Central de Chile en temas de Mercados de Capitales, Eficiencia de Mercado, Riesgo Financiero, Econometría y Estadística. En el área académica ha sido catedrático en temas como: Probabilidad y Estadística, Econometría Financiera, Formulación y Evaluación de Proyecto, y en ramas de ingeniería como Investigación de Operaciones y Taller de Ingeniería Civil Industrial.

Información General

Duración

1 Hora

Fecha de Inicio

Vie. 25 de Ene de 2019

Horarios

08:00 a.m San José de Costa Rica - CDMX
09:00 a.m Bogotá - Quito - Lima
10:00 a.m La Paz - Caracas
11:00 a.m Buenos Aires - Santiago de Chile

Herramientas de apoyo

EViews®

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