

Entrenamiento Especializado

Entrenamiento presencial: Herramientas Analíticas para el Modelado Financiero y Cuantificación del Riesgo.

Descripción

La aplicación de métodos cuantitativos ha permitido mejorar la precisión de eventos inciertos en el modelado financiero, el buen uso del concepto teórico y su aplicación en herramientas analíticas como son **EViews** y **Risk Simulator** permitirán desarrollar modelos robustos y probabilísticos para la toma de decisiones en escenarios bajo incertidumbre.

Dirigido a

Analistas y Gerentes Financieros y de Riesgos, Consultores, Estudiantes de disciplinas Financieras, Económicas e Ingenierías y en general todas aquellas personas interesadas en conocer los principales Métodos Cuantitativos aplicados para el Análisis Financiero y Valoración de Riesgos.

Objetivo

- Conocer los principales Fundamentos Teóricos para el Modelado Financiero bajo Incertidumbre.
- Aplicar Métodos Cuantitativos para el Análisis Financiero y Valoración de Riesgos.
- Emplear herramientas analíticas para el desarrollo de rutinas avanzadas y automatizadas.

Temario

MODULO I

Herramienta de apoyo: Risk Simulator

Simulación de Monte Carlo para el Modelado Financiero

- Introducción a la Estadística Descriptiva e Inferencial.
- Principales Distribuciones de Probabilidad.
- Generación de Números Aleatorios.
- Pruebas de Aleatoriedad y Normalidad de Datos.
- Ajustes de Distribución de Probabilidad.
- Modelo de Simulación de Brechas para el Análisis de Riesgo de Liquidez (ALM).
- Construcción de Portafolios de Inversión con Activos de Renta Fija (MVO).
- Modelos de Cuantificación de Riesgo de Mercado para Activos Renta Fija (VaR y CVaR).

Metodologías para el Cálculo de Volatilidades

- Aproximación del Coeficiente de Variación.
- Aproximación del Retorno Logarítmico del Flujo de Caja.
- Aproximación del Retorno de los Activos: Volatilidad Histórica vs Volatilidad Dinámica.
- Enfoque de Probabilidad.
- Modelos de Volatilidad Condicional: ARCH (q), GARCH (p,q).

MODULO II

Herramienta de apoyo: EViews

Principales Técnicas de Pronóstico en Finanzas

- Regresión Lineal Simple y Múltiple.
- Validación de los modelos estimados por Mínimos Cuadrados Ordinarios.
- Modelos Univariados de Series de Tiempo (ARIMA y SARIMA).
- Modelos de Volatilidad Dinámica y Condicional (EWMA, GARCH).

Instructores

Miguel Ángel Bello Bernal, Mag.

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

20 Horas

Fecha de Inicio

Lun. 26 de Nov de 2018

Horarios

De:

9:00 am a 1:00 pm

Fechas:

Noviembre 26 al 30 de 2018

Lugar:

Universidad Mayor de San Andres

Facultad de Ciencias Económicas y Financieras

Monoblock Central - Avenida Villazón N. 1995

Aula Multipropósito - Piso 5

Ciudad

La Paz (La Paz, Bolivia)

Lugar:

Software Shop

Herramientas de apoyo



Mayores informes de inscripción y costos

Entrenamientos@Software-Shop.com

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