

Webcast

Análisis de Riesgo a Instrumentos de Renta Variable

Descripción

Presentación vía web que abarcará desde un enfoque práctico las principales metodologías de simulación, la utilización de herramientas analíticas para la modelación de series financieras y sus interpretaciones utilizando la herramienta Risk Simulator.

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 el modelado de series financieras mediante Risk Simulator.

Objetivo

- Dar a conocer el concepto de Procesos Estocásticos y Series de Tiempo.
- Conocer los principales estadígrafos en la interpretación de Series Financieras.
- Dar conocer los principales hechos estilizados y cálculos de retornos.
- Aprender a utilizar las herramientas analíticas y de Simulación de Monte Carlo dentro del modelado.

Temario

1. Introducción a los Procesos Estocásticos y las Series de Tiempo.
2. Introducción a la Estadística Financiera.
 - a. Medidas de Variabilidad.
 - b. Cálculo de Retornos Continuos y Discretos (Ventajas y Desventajas).
 - c. Momentos de las Distribuciones de Probabilidad.
3. Conceptos a los hechos estilizados presentes en las series financieras.
4. Simulaciones y Herramientas Analíticas.

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. 15 de Feb de 2019

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