

Descripción

En esta presentación se abordará 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) utilizando EViews 11 como herramienta de apoyo para realizar dichos procedimientos de manera ágil y eficiente.

Dirigido a

Gerentes, consultores, analistas financieros y de riesgos, docentes, estudiantes y profesionales de disciplinas financieras y económicas y en general todas aquellas personas interesadas en aplicar los conceptos de volatilidad histórica y volatilidad condicional al análisis de los retornos de activos financieros con apoyo de Eviews 11.

Objetivo

- Presentar los conceptos de Volatilidad Histórica y Volatilidad Condicional aplicados a los retornos de los activos financieros.
- Aprender a calcular la varianza de activos financieros con diferentes metodologías para luego aplicarla en el cálculo del Valor en Riesgo paramétrico (VaR).

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

Jue. 07 de Nov de 2019

Horarios

09:00 a.m San José de Costa Rica

10:00 a.m Bogotá - Quito - Lima - CDMX

11:00 a.m La Paz - Caracas

12:00 m Buenos Aires- Santiago de Chile

EViews[®] 11

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