Webcast

Modelos de volatilidad condicional y series de tiempo financieras con apoyo de Eviews 11

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

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

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

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