

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

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. 16 de Ene de 2020

Horarios

09:00 a.m San José de Costa Rica - CDMX

10:00 a.m Bogotá - Quito - Lima

11:00 a.m La Paz - Caracas

12:00 m Buenos Aires - Santiago de Chile



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