

Webcast

Modelos de Volatilidad Condicional con EViews

Descripción

Presentación vía web que abarca 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) con el software EViews.

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 conocer los principales modelos de series de tiempo en EViews.

Objetivo

1. Conocer los conceptos de Volatilidad Histórica y Volatilidad Condicional aplicados a los retornos de los activos financieros.
2. Aprender a calcular la varianza de activos financieros con diferentes

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. 02 de Abr de 2020

Horarios

10:30 a.m San José de Costa Rica - CDMX

11:30 a.m Bogotá - Quito - Lima

12:30 a.m La Paz - Caracas

1:30 p.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