

Finanzas cuantitativas: aplicaciones en Excel, SPSS y Eviews

Duración del curso: 15 + 15 horas

Contacto: David Trillo (tf. 607 753 543) vilaconsultores@telefonica.net

Módulos: 4 sesiones de 3 horas impartidas en 4 tardes con horario y fecha a convenir

Objetivo del curso: el curso persigue una formación avanzada en finanzas cuantitativas para profesionales del entorno financiero y contable. En este curso se plantea un taller en Excel por cada aplicación del programa que el profesor realizará en la sala de informática a la vez que los alumnos. El módulo complementario de regresión y modelos de elección discreta se puede cursar por separado.

Lugar: aulas del Instituto Universitario IDP en la Universidad Rey Juan Carlos

Módulo I: Aplicaciones en Excel para la valoración y el análisis de riesgos

Apartado	Aplicaciones
Intereses: capitalización simple, compuesta y continua	Análisis de inversiones, estrategias financieras y valoración de instrumentos
Precio de un bono cupón cero	Valoración de instrumentos financieros y mercados de deuda, Banca y departamentos financieros
TIR de un bono cupón cero	Valoración de instrumentos financieros y mercados de deuda
Precio de un bono con cupones	Valoración de instrumentos financieros y mercados de deuda
TIR de un bono con cupones	Valoración de instrumentos financieros y mercados de deuda
Duración de un bono y convexidad de un bono	Análisis del riesgo de los instrumentos
Tipos de interés cupón cero	Valoración de instrumentos de deuda y derivados
Tipos de interés forward implícitos	Expectativas de tipos de interés, Margen financiero, Valoración de derivados
Cuota de un préstamo sistema de amortización francés	Banca y departamentos financieros
Tipo de interés efectivo	Contabilidad, auditoría, regulación
Instrumentos financieros a coste amortizado	Contabilidad, auditoría, regulación

Media Varianza Desviación típica Coeficiente de correlación	Múltiples aplicaciones en el entorno empresarial
Beta de una acción	Múltiples aplicaciones en el entorno empresarial
Volatilidad	Contabilidad, Valor razonable, Riesgo de mercado
Valor en riesgo RiskMetrics	Análisis de riesgo de mercado

Módulo 2: Aplicaciones econométricas en Eviews y SPSS

Módulo	Aplicaciones
Modelo de regresión múltiple	Análisis e identificación de factores que inciden en resultados (múltiples aplicaciones)
Modelos logit y probit	Credit scoring

