

Analítica Financiera

Escuela en Métodos

Centro Hodos, Universidad Católica del Uruguay

Modalidad: Presencial

Docente: Juan Pablo Viteri

Correo: juan.viteri@ucu.edu.uy

Este curso ofrece una visión global del campo del Análisis Financiero Cuantitativo, que implica la aplicación de métodos matemáticos y estadísticos a la toma de decisiones financieras. El curso abarcará los conceptos y técnicas fundamentales de las finanzas cuantitativas, incluidos el análisis estadístico de momentos, la teoría de carteras y la gestión de riesgos.

Objetivos del curso:

El objetivo es que los estudiantes aprendan a analizar e interpretar datos financieros para gestionar el riesgo y tomar decisiones informadas. El curso pretende proveer a los estudiantes de los conocimientos y habilidades necesarios para analizar e interpretar datos financieros con eficacia. Al final del curso, los estudiantes serán capaces de abordar problemas de gestión de riesgo utilizando métodos cuantitativos utilizando el software R.

Público objetivo: Este curso está dirigido a profesionales de las áreas de Ciencias Administrativas y Económicas con conocimientos básicos de programación. No se requiere un nivel avanzado de R para participar.

Modalidad: Este curso promueve un enfoque de aprendizaje basado en proyectos, comenzando con una sólida base en métodos estadísticos y modelos financieros. Posteriormente, los estudiantes aplicarán estos conocimientos en un proyecto práctico centrado en activos financieros de su elección.

Estructura del curso:

El curso está compuesto por cuatro unidades, cada una incluye un laboratorio en R.

Unidad 1: Fundamentos del análisis financiero cuantitativo

Esta unidad introduce a los estudiantes a los conceptos y técnicas del análisis de activos financieros utilizando métodos cuantitativos.

Unidad 2: Hechos estilizados de series financieras:

Esta unidad explorar patrones y características que presentan las series financieras, conocidos como hechos estilizados.

Unidad 3: Introducción a la teoría de portafolio:

En esta unidad se presentan los fundamentos de la teoría de portafolio, enfocándose en la gestión del riesgo mediante la diversificación.

Unidad 4: Modelo CAPM y FF3

En esta unidad se hace el análisis y aplicación práctica del Modelo de Valoración de Activos Financieros (CAPM) y el modelo de tres factores de Fama y French.

Bibliografía:

- Scheuch, C., Voigt, S., Weiss P. (2023). CRC Press. Tidy Finance with R.
<https://www.tidy-finance.org/r/>
- Regenstein, J.K, (2019). Reproducible Finance with R. CRC Press.
<http://www.reproduciblefinance.com>
- Wickham, H., Çetinkaya-Rundel, M., & Grolemund, G. (2023). R for data science. O'Reilly Media, Inc. <https://r4ds.hadley.nz/>