

GESTIÓN DE RIESGOS EN TRADING DE DIVISAS Y CRIPTOMONEDAS

Elaboró: Dr. Robert Hernández Martínez – robert@actuariayfinanzas.net

Duración:

30 horas

Objetivo general:

Proporcionar herramientas de consultoría en gestión de riesgos en trading de divisas y criptomonedas.

Objetivos particulares:

- Presentar estrategias de trading con base en estadísticas financieras y gráficas en tiempo real.
- Diseñar modelos computacionales para optimizar decisiones de trading en escenarios de incertidumbre.

Población objetivo:

- Consultores
- Analistas
- Gestores de riesgos

METODOLOGÍA

Actividades didácticas:

- Exposición del ponente
- Lluvia de ideas
- Elaboración de mapas mentales
- Elaboración de diagramas de causa - efecto
- Elaboración de cuadros comparativos
- Elaboración de diagramas de proceso
- Elaboración de dashboards
- Análisis de lecturas
- Estudio de casos
- Diseño de modelos computacionales con el software propuesto

Recursos didácticos:

Software:

- ✓ Microsoft Excel
- ✓ Crystal Ball
- ✓ Power BI
- ✓ Internet

Evaluación:

Exposición de proyectos:

- ✓ Resumen ejecutivo de un caso práctico
- ✓ Presentación de resultados
- ✓ Conclusiones
- ✓ Retroalimentación

TEMARIO

1. MERCADOS FINANCIEROS

- 1.1. Finanzas personales. A mayor rendimiento, mayor riesgo
- 1.2. Evolución de los mercados financieros
- 1.3. Activos financieros operados
- 1.4. Divisas y criptomonedas

2. OPERACIÓN EN PLATAFORMA

- 2.1. Requerimientos de instalación
- 2.2. Creación de cuenta demo
- 2.3. Configuración del monitor de información financiera
- 2.4. Bases de datos de estadísticas financieras

3. MONITOR DE MERCADOS

- 3.1. Análisis fundamental. La importancia del entorno económico
- 3.2. Análisis técnico. La importancia de las gráficas
- 3.3. Tendencias en cotizaciones de divisas y criptomonedas
- 3.4. Rendimientos pasados no garantizan rendimientos futuros

4. ESTRATEGIAS DE TRADING CON MODELACIÓN FINANCIERA EN EXCEL Y DASHBOARDS EN POWER BI

- 4.1. Objetividad en las decisiones
- 4.2. Estrategias básicas de trading
- 4.3. Modelación financiera en Excel y dashboards en Power BI
- 4.4. Escenarios: Análisis de sensibilidad. ¿Qué pasa si...?

5. GESTIÓN DE RIESGOS DE MERCADO

- 5.1. Cálculo del riesgo versus rendimiento.
- 5.2. Estrategias automatizadas.
- 5.3. Trading acorde a tendencias
- 5.4. Casos prácticos

6. TRADING EN CUENTA DEMO

6.1. Ventajas de la cuenta demo

6.2. Errores comunes al operar

6.3. El futuro de los mercados: Algoritmos e Inteligencia Artificial

6.4. Cisnes negros. El impacto de lo improbable

Bibliografía:

Larson (2020) Data Analysis with Microsoft Power BI. McGraw Hill. USA.

Anderson; Sweeney; Williams (2019) Fundamentos de métodos cuantitativos para los negocios. Cengage Learning Editores. México.

Deckler (2019) Learn Power BI. A Beginner's Guide to Developing Interactive Business Intelligence Solutions Using Microsoft Power BI. Packt Publishing. UK.

Rad (2019) Power BI MVP Book. A book of tricks and techniques for working with Power BI.

Guerrero (2019) Excel Data Analysis. Modeling and Simulation. Springer. USA.

Ferrari (2017) Analyzing Data with Power BI and Power Pivot for Excel. Microsoft Press. USA.

Salkind (2017) Statistics for people who (think they) hate statistics. Using Microsoft Excel 2016. SAGE Publications. USA.

Anderson, Sweeney, Williams, Camm, Cochran (2016) Estadística para negocios y economía. Cengage Learning Editores. México.

Quirk (2016) Excel 2016 for Business Statistics. A Guide to Solving Practical Problems. Springer. USA.

Collie (2016) Power Pivot and Power BI. The Excel User's Guide to DAX Power Query Power BI and Power Pivot in Excel 2010-2016. Holy Macro! Books. USA.

Tetlock, Gardner (2015) Superforecasting. The art and science of prediction. Crown Publishers. New York.

Holden (2015) Excel modeling in Corporate Finance. Pearson. USA.

Alastair (2015) Mastering Financial Mathematics in Microsoft Excel. A practical guide for business calculations. Pearson. USA.

Decker (2014) Microsoft Business Intelligence Tools for Excel Analysts. John Wiley & Sons, Inc. USA.

Luenberger David G. (2013) Investment Science. Oxford University Press. New York.

Wooldridge (2013) Introductory Econometrics. A modern approach. Cengage Learning. USA.

Greene (2012) Econometric Analysis. Prentice Hall. USA.

Charnes (2012) Financial Modeling with Crystal Ball and Excel. John Wiley & Sons, Inc. USA.

Winston, Wayne L. (2011) Microsoft Excel 2010 Data Analysis and Business Modeling. Microsoft Press. USA.

Gregoriou (2011) Financial Econometrics Modeling Derivatives Pricing Hedge Funds and Term Structure Models. Palgrave Macmillan. UK.

Hanke; Wichern (2010) Pronósticos en los negocios. Prentice - Hall. México.

Wooldridge (2010) Introducción a la Econometría. Un enfoque moderno. Cengage Learning. México.

Proctor, K. Scott (2010) Building Financial Models with Microsoft Excel. A Guide for Business. John Wiley & Sons, Inc. USA.

Tom Y. Sawyer (2009) Pro Excel Financial Modeling. Building Models for Technology Startups. Apress. USA.

Horowitz (2009) Semiparametric and Nonparametric Methods in Econometrics. Springer. USA.

Fraser (2009) Business Statistics for Competitive Advantage with Excel 2007. Basics Model Building and Cases. Springer. USA.

Lemieux (2009) Monte Carlo and Quasi-Monte Carlo Sampling. Springer. USA.

Hyndman (2008) Forecasting with Exponential Smoothing. The State Space Approach. Springer. USA.

Gutiérrez (2008) Modelos Financieros con EXCEL. Herramientas para mejorar la toma de decisiones empresariales. Ecoe Ediciones. Colombia.

Montgomery Douglas C. (2008) Introduction to Time Series Analysis and Forecasting. John Wiley & Sons, Inc. USA.

Holden (2008) Excel Modeling and Estimation in Corporate Finance. Prentice Hall. USA.

Nassim Nicholas Taleb (2007) The Black Swan. The Impact of the Highly Improbable. Random House. USA.

Loffler; Posch (2007) Credit Risk Modeling using Excel and VBA. John Wiley & Sons, Inc. USA.

Actuaría & Finanzas

www.actuariayfinanzas.net

Aching (2006) Aplicaciones financieras de Excel con Matemáticas Financieras. Prociencia y Cultura.

Mun (2006) Modeling Risk Applying Monte Carlo Simulation Real Options Analysis Forecasting and Optimization Techniques. John Wiley & Sons, Inc. USA.

Sarmiento (2005) Matemáticas Financieras con Excel. Pontificia Universidad Javeriana. Bogotá.

Good (2005) Introduction to Statistics through Resampling Methods and Microsoft Office Excel. John Wiley & Sons, Inc. USA.

Focardi; Fabozzi (2004) The Mathematics of Financial Modeling and Investment Management. John Wiley & Sons, Inc. USA.

Creel (2004) Econometrics. Universitat Autònoma de Barcelona. Spain.

Alemán Cartilla; Ma. Cristina (2003) Modelos financieros en Excel. CECSA. México.

Wang Peijie (2003) Financial Econometrics Methods and Models. Routledge. USA.

Jackel Peter (2002) Monte-Carlo Methods in Finance. John Wiley & Sons, Inc. USA.

Wooldridge (2002) Econometric analysis of cross section and panel data. The MIT Press. England.

Salvatore Dominik (2002) Statistics and Econometrics. McGraw Hill. USA.

Benninga, Simon (2000) Financial Modeling Uses Excel. The MIT Press Cambridge. Massachusetts London. England.

Chatfield Chris (2000) Time-Series Forecasting. Chapman & C Hall/CRC. USA.