



INESEM

BUSINESS SCHOOL

Máster en Banca y Finanzas Cuantitativas

+ Información Gratis

titulación de formación continua bonificada expedida por el instituto europeo de estudios empresariales

Máster en Banca y Finanzas Cuantitativas

duración total: 1.500 horas

horas teleformación: 450 horas

precio: 0 € *

modalidad: Online

* hasta 100 % bonificable para trabajadores.

descripción

En la actualidad la elevada existencia de productos financieros y mercados, provoca la necesidad por parte de las empresas de tener profesionales que sean capaces de llevar a cabo una investigación y análisis a través de medios estadísticos que le permita obtener una rentabilidad elevada con reducido riesgo derivado de sus cálculos. Este máster le permitirá especializarse de forma eficaz en el análisis de productos a través de herramientas estadísticas, así como conocer todos aquellos aspectos que engloban el funcionamiento del sistema financiero, mercados y productos financieros existentes en la actualidad. INESEM te proporcionará todo el conocimiento necesario en materia estadístico- financiero que te permite desenvolverte eficazmente en cualquier rama de investigación empresarial.



+ Información Gratis

a quién va dirigido

Todos aquellos trabajadores y profesionales en activo que deseen adquirir o perfeccionar sus conocimientos técnicos en este área.

objetivos

- Conocer los fundamentos principales la estadística aplicada
- Aprender las técnicas de investigación basadas en inferencia estadística
- Conocer los aspectos más avanzado del sistema financiero a nivel de mercados y productos.
- Desarrollar capacidades que permitan evaluar el riesgo y la rentabilidad de los diferentes productos financieros.

para qué te prepara

El Master en Banca y Finanzas Cuantitativas te especializará en el ámbito estadístico y financiero ayudándote a llevar a cabo un análisis eficaz de los mercados financieros y de los productos existentes a través del uso de las diferentes herramientas estadísticas aplicables en la actualidad. Te formarás en el campo de la estadística aplicable al ámbito financiero y a como esta se utiliza en la investigación de mercados, riesgos y rentabilidad.

salidas laborales

Desarrolla tu carrera profesional empresarial en el ámbito financiero especializado en el análisis de riesgos y rentabilidad, derivados del estudio de los productos existentes en los mercados, desempeñando puestos de gerente de riesgos, ingeniero financiero u operador de derivados y cualquier tarea relacionado con la investigación de mercados financieros.

titulación

Una vez finalizado el curso, el alumno recibirá por parte de INESEM vía correo postal, la Titulación Oficial que acredita el haber superado con éxito todas las pruebas de conocimientos propuestas en el mismo.

Esta titulación incluirá el nombre del curso/máster, la duración del mismo, el nombre y DNI del alumno, el nivel de aprovechamiento que acredita que el alumno superó las pruebas propuestas, las firmas del profesor y Director del centro, y los sellos de la instituciones que avalan la formación recibida (Instituto Europeo de Estudios Empresariales).



INSTITUTO EUROPEO DE ESTUDIOS EMPRESARIALES

como centro de Formación acreditado para la impartición a nivel nacional de formación
EXPIDE LA SIGUIENTE TITULACIÓN

NOMBRE DEL ALUMNO/A

con D.N.I. XXXXXXXX ha superado los estudios correspondientes de

Nombre de la Acción Formativa

de XXX horas, perteneciente al Plan de Formación INESEM en la convocatoria de XXXX
Y para que surta los efectos pertinentes queda registrado con número de expediente XXXX- XXXX-XXXX-XXXXXX

Con una calificación de SOBRESALIENTE

Y para que conste expido la presente TITULACIÓN en
Granada, a (día) de (mes) de (año)

La dirección General

MARIA MORENO HIDALGO

Firma del alumno/a

Sello



NOMBRE DEL ALUMNO/A

forma de bonificación

- Mediante descuento directo en el TC1, a cargo de los seguros sociales que la empresa paga cada mes a la Seguridad Social.

metodología

El alumno comienza su andadura en INESEM a través del Campus Virtual. Con nuestra metodología de aprendizaje online, el alumno debe avanzar a lo largo de las unidades didácticas del itinerario formativo, así como realizar las actividades y autoevaluaciones correspondientes. Al final del itinerario, el alumno se encontrará con el examen final, debiendo contestar correctamente un mínimo del 75% de las cuestiones planteadas para poder obtener el título.

Nuestro equipo docente y un tutor especializado harán un seguimiento exhaustivo, evaluando todos los progresos del alumno así como estableciendo una línea abierta para la resolución de consultas.

El alumno dispone de un espacio donde gestionar todos sus trámites administrativos, la Secretaría Virtual, y de un lugar de encuentro, Comunidad INESEM, donde fomentar su proceso de aprendizaje que enriquecerá su desarrollo profesional.

materiales didácticos

- Manual teórico 'Valoración de Proyectos de Inversión'
- Manual teórico 'Mercado de Capitales y Monetario'
- Manual teórico 'La Inferencia Estadística Financiera'
- Manual teórico 'Microeconometría'
- Manual teórico 'Gestión y Análisis de Riesgos Financieros'
- Manual teórico 'Introducción a la Estadística'
- Manual teórico 'Elaboración de Carteras Eficientes'



profesorado y servicio de tutorías

Nuestro equipo docente estará a su disposición para resolver cualquier consulta o ampliación de contenido que pueda necesitar relacionado con el curso. Podrá ponerse en contacto con nosotros a través de la propia plataforma o Chat, Email o Teléfono, en el horario que aparece en un documento denominado “Guía del Alumno” entregado junto al resto de materiales de estudio. Contamos con una extensa plantilla de profesores especializados en las distintas áreas formativas, con una amplia experiencia en el ámbito docente.

El alumno podrá contactar con los profesores y formular todo tipo de dudas y consultas, así como solicitar información complementaria, fuentes bibliográficas y asesoramiento profesional. Podrá hacerlo de las siguientes formas:

- **Por e-mail:** El alumno podrá enviar sus dudas y consultas a cualquier hora y obtendrá respuesta en un plazo máximo de 48 horas.

- **Por teléfono:** Existe un horario para las tutorías telefónicas, dentro del cual el alumno podrá hablar directamente con su tutor.

- **A través del Campus Virtual:** El alumno/a puede contactar y enviar sus consultas a través del mismo, pudiendo tener acceso a Secretaría, agilizando cualquier proceso administrativo así como disponer de toda su documentación



plazo de finalización

El alumno cuenta con un período máximo de tiempo para la finalización del curso, que dependerá de la misma duración del curso. Existe por tanto un calendario formativo con una fecha de inicio y una fecha de fin.

campus virtual online

especialmente dirigido a los alumnos matriculados en cursos de modalidad online, el campus virtual de inesem ofrece contenidos multimedia de alta calidad y ejercicios interactivos.

comunidad

servicio gratuito que permitirá al alumno formar parte de una extensa comunidad virtual que ya disfruta de múltiples ventajas: becas, descuentos y promociones en formación, viajes al extranjero para aprender idiomas...

revista digital

el alumno podrá descargar artículos sobre e-learning, publicaciones sobre formación a distancia, artículos de opinión, noticias sobre convocatorias de oposiciones, concursos públicos de la administración, ferias sobre formación, etc.

secretaría

Este sistema comunica al alumno directamente con nuestros asistentes, agilizando todo el proceso de matriculación, envío de documentación y solución de cualquier incidencia.

Además, a través de nuestro gestor documental, el alumno puede disponer de todos sus documentos, controlar las fechas de envío, finalización de sus acciones formativas y todo lo relacionado con la parte administrativa de sus cursos, teniendo la posibilidad de realizar un seguimiento personal de todos sus trámites con INESEM

programa formativo

MÓDULO 1. INTRODUCCIÓN A LA ESTADÍSTICA

UNIDAD DIDÁCTICA 1. CONCEPTOS BÁSICOS Y ORGANIZACIÓN DE DATOS

- 1.Aspectos introductorios a la Estadística
- 2.Concepto y funciones de la Estadística
- 3.Medición y escalas de medida
- 4.VARIABLES: clasificación y notación
- 5.Distribución de frecuencias
- 6.Representaciones gráficas
- 7.Propiedades de la distribución de frecuencias

UNIDAD DIDÁCTICA 2. ESTADÍSTICA DESCRIPTIVA BÁSICA

- 1.Estadística descriptiva
- 2.Estadística inferencial

UNIDAD DIDÁCTICA 3. MEDIDAS DE TENDENCIA CENTRAL Y POSICIÓN

- 1.Medidas de tendencia central
- 2.La media
- 3.La mediana
- 4.La moda
- 5.Medidas de posición
- 6.Medidas de variabilidad
- 7.Índice de Asimetría de Pearson
- 8.Puntuaciones típicas

UNIDAD DIDÁCTICA 4. ANÁLISIS CONJUNTO DE VARIABLES

- 1.Introducción al análisis conjunto de variables
- 2.Asociación entre dos variables cualitativas
- 3.Correlación entre dos variables cuantitativas
- 4.Regresión lineal

UNIDAD DIDÁCTICA 5. DISTRIBUCIONES DE PROBABILIDAD

- 1.Conceptos previos de probabilidad
- 2.VARIABLES discretas de probabilidad
- 3.Distribuciones discretas de probabilidad
- 4.Distribución Normal
- 5.Distribuciones asociadas a la distribución Normal

UNIDAD DIDÁCTICA 6. INTRODUCCIÓN A LA ESTADÍSTICA EN PROGRAMAS INFORMÁTICOS. EL SPSS

- 1.Introducción
- 2.Cómo crear un archivo
- 3.Definir variables
- 4.VARIABLES y datos
- 5.Tipos de variables
- 6.Recodificar variables
- 7.Calcular una nueva variable
- 8.Ordenar casos
- 9.Seleccionar casos

UNIDAD DIDÁCTICA 7. ESTADÍSTICA DESCRIPTIVA CON SPSS

- 1.Introducción
- 2.Análisis de frecuencias
- 3.Tabla de correlaciones
- 4.Diagramas de dispersión
- 5.Covarianza

6. Coeficiente de correlación
7. Matriz de correlaciones
8. Contraste de medias

MÓDULO 2. LA INFERENCIA ESTADÍSTICA FINANCIERA

UNIDAD DIDÁCTICA 1. MODELOS PROBABILÍSTICOS UNIVARIANTES CONTINUOS

1. Distribuciones continuas básicas
2. Distribución normal
3. Aplicaciones de los modelos geométricos
4. Distribuciones relacionadas con las integrales eulerianas
5. Distribuciones relacionadas con la distribución normal
6. Convergencias en distribución

UNIDAD DIDÁCTICA 2. DISTRIBUCIONES ASOCIADAS A LOS ESTADÍSTICOS MUESTRALES DE UNA POBLACIÓN NORMAL

1. Distribución para la media de una muestra normal
2. Distribución para la varianza y cuasivarianza de una muestra normal
3. Distribuciones de probabilidad para la diferencia de medias de dos muestras independientes normales
4. Distribución para el cociente de varianzas
5. Distribución para la proporción muestral

UNIDAD DIDÁCTICA 3. ESTIMACIÓN PUNTUAL DE PARÁMETROS

1. Método de máxima verosimilitud
2. Método de los momentos
3. Relación entre el método de máxima verosimilitud y el de los momentos
4. Propiedades deseables para un estimador paramétrico

UNIDAD DIDÁCTICA 4. ESTIMACIÓN MEDIANTE INTERVALOS DE CONFIANZA

1. Intervalos de confianza para la media de una distribución normal
2. Intervalo de confianza para una proporción
3. Intervalo de confianza para la diferencia de medias de dos poblaciones normales
4. Intervalo de confianza para la diferencia de proporciones
5. Intervalo de confianza para la varianza de una población normal
6. Intervalo de confianza para la razón de varianzas
7. Construcción de regiones de confianza

UNIDAD DIDÁCTICA 5. CONTRASTE DE HIPÓTESIS

1. Formulación de un contraste de hipótesis
2. Contraste de hipótesis para la media de una población normal
3. Contraste para la diferencia de medias
4. Contraste para la diferencia de proporciones
5. Contraste para la varianza
6. Contraste para la razón de varianzas
7. Análisis de razón de verosimilitudes

UNIDAD DIDÁCTICA 6. INTRODUCCIÓN A LA ECONOMETRÍA

1. Introducción a los modelos econométricos
2. Especificación y estimación del modelo lineal simple
3. Estimación de la varianza de la perturbación aleatoria

UNIDAD DIDÁCTICA 7. EL MODELO LINEAL SIMPLE NORMAL

1. Conceptualización
2. Obtención de los estimadores mínimo-cuadráticos
3. Propiedades descriptivas en la regresión lineal simple
4. Medidas de la bondad del ajuste. El coeficiente de determinación
5. Hipótesis estadísticas del modelo
6. Propiedades probabilísticas del modelo
7. Análisis de la varianza en la regresión

8.Ejercicio tipo del MLS

MÓDULO 3. MICROECONOMETRÍA

UNIDAD DIDÁCTICA 1. EL MODELO DE REGRESIÓN LINEAL MÚLTIPLE

- 1.Introducción
- 2.Especificación del modelo de regresión lineal múltiple
- 3.Inferencia estadística del MRLM I
- 4.Inferencia estadística del MRLM II
- 5.Sumas de cuadrados, análisis de la varianza y R²
- 6.El proceso de predicción
- 7.Estimación restringida
- 8.Contrastes de cambio estructural, linealidad y normalidad
- 9.Errores de especificación

UNIDAD DIDÁCTICA 2. PROBLEMAS CON LA INFORMACIÓN: ANÁLISIS DE OBSERVACIONES Y MULTICOLINEALIDAD

- 1.Introducción
- 2.Influencia potencial
- 3.Influencia real
- 4.Observaciones atípicas
- 5.Multicolinealidad: definición, grados y consecuencias
- 6.Principales criterios de detección para la multicolinealidad
- 7.Posibles soluciones a la multicolinealidad

UNIDAD DIDÁCTICA 3. INFORMACIÓN CUALITATIVA: VARIABLES FICTICIAS

- 1.Introducción
- 2.El modelo de regresión con variables ficticias
- 3.Una nueva versión del contraste de cambio estructural

UNIDAD DIDÁCTICA 4. EL MODELO DE REGRESIÓN LINEAL MÚLTIPLE GENERALIZADO. PERTURBACIÓN NO ESFÉRICA: HETEROSCEDASTICIDAD Y AUTOCORRELACIÓN

- 1.Introducción
- 2.Consecuencias en la estimación por MCO
- 3.Estimador Mínimo Cuadrático Generalizado (MCG)
- 4.Comparación entre el estimador MCO y MCG
- 5.Heteroscedasticidad
- 6.Métodos de estimación en presencia de heteroscedasticidad
- 7.Contrastes de heteroscedasticidad
- 8.Autocorrelación
- 9.Esquemas lineales con comportamiento autocorrelacionado
- 10.Métodos de estimación en presencia de autocorrelación
- 11.Contrastes de autocorrelación

MÓDULO 4. VALORACIÓN DE PROYECTOS DE INVERSIÓN

UNIDAD DIDÁCTICA 1. LOS PROYECTOS DE INVERSIÓN

- 1.Definición y tipos de inversión
- 2.El ciclo de vida de un proyecto de inversión
- 3.Componentes de un proyecto de inversión

UNIDAD DIDÁCTICA 2. VALORACIÓN ECONÓMICO DE INVERSIONES

- 1 Metodologías de valoración económica
2. Clasificación de los flujos de caja
3. Criterios VAN y TIR de análisis de inversiones
4. Elección del proyecto de inversión

UNIDAD DIDÁCTICA 3. VALORACIÓN DE RIESGOS

1. Metodologías de tratamiento del riesgo

2. Análisis de la sensibilidad
3. Árboles de decisión para la toma de decisiones secuenciales

UNIDAD DIDÁCTICA 4. TIPOS DE PROYECTOS DE INVERSIÓN

1. Proyectos de inversión en activos fijos
2. Proyectos de inversión en capital circulante (NOF)

UNIDAD DIDÁCTICA 5. COSTE DE LA DEUDA Y COSTE DE CAPITAL

1. Cálculo del coste de la deuda
2. Cálculo del coste medio ponderado de capital (WACC)

UNIDAD DIDÁCTICA 6. VALORACIÓN DE INVERSIONES ESPECIALES

1. Compra o alquiler
2. Inversión en ampliación
3. Inversión en outsourcing

MÓDULO 5. MERCADO DE CAPITALES Y MONETARIO

UNIDAD DIDÁCTICA 1. RENTA FIJA

1. Los títulos de renta fija como instrumentos de financiación y de inversión
2. Nomenclatura del préstamo y del empréstito
3. Mercados: descripción y participantes
4. Tipos de interés de referencia de la Unión Económica y Monetaria (UEM)
5. El Banco Central Europeo (BCE)
6. El Sistema Europeo de Bancos Centrales (SEBC)
7. El Banco de España

UNIDAD DIDÁCTICA 2. RENTA FIJA II

1. Clasificación de los títulos
2. Valoración de las letras del tesoro
3. Bonos y obligaciones con cupón corrido
4. Repos y strips o bonos segregables
5. Cálculo del valor actual de un bono
6. Bonos cupón cero: valoración, riesgo y rentabilidad
7. Riesgo de mercado y de reinversión

UNIDAD DIDÁCTICA 3. RENTA VARIABLE

1. Concepto de activo de Renta Variable
2. Derechos de los accionistas, ventajas e inconvenientes
3. Clasificación de las acciones
4. Capitalización bursátil y liquidez
5. Estructura de la bolsa española
6. La contratación y la operativa bursátil

MÓDULO 6. ELABORACIÓN DE CARTERAS EFICIENTES

UNIDAD DIDÁCTICA 1. CARTERAS DE VALORES

1. Teoría y gestión de carteras: fundamentos
2. Evaluación del riesgo según el perfil del inversor
3. Función de utilidad de un inversor con aversión al riesgo
4. Ejercicio Resuelto. Cálculo de la rentabilidad de una cartera

UNIDAD DIDÁCTICA 2. POLÍTICAS DE DIVIDENDOS

1. Dividendos y sus clases
2. Relevancia de la política de dividendos
3. Dividendos e imperfecciones del mercado
4. Dividendos e impuestos
5. Ejercicio Resuelto. Cálculo y tributación de dividendos

UNIDAD DIDÁCTICA 3. CARTERAS DE FONDOS DE INVERSIÓN

1. Los fondos de inversión

- 2.Sociedades de Inversión de Capital Variable (SICAV)
- 3.Fondos de inversión libre
- 4.Fondos de fondos de inversión libre
- 5.Fondos cotizados o ETF
- 6.Ejercicio Resuelto. Letras del tesoro

UNIDAD DIDÁCTICA 4. MODELO CAPM

- 1.Teoría de separación en dos fondos
- 2.Capital Asset Pricing Model (CAPM)
- 3.Soluciones a la optimización estática

UNIDAD DIDÁCTICA 5. ESTRUCTURACIÓN DE CARTERAS EN SOFTWARE R

- 1.Introducción
- 2.Creación y optimización de portfolios en R
- 3.Cálculo de Backtest

MÓDULO 7. GESTIÓN Y ANÁLISIS DE RIESGOS FINANCIEROS

UNIDAD DIDÁCTICA 1. ANÁLISIS DEL RIESGO FINANCIERO

- 1.Concepto de riesgo y consideraciones previas
- 2.Tipos de riesgo
- 3.Condiciones del equilibrio financiero
- 4.El capital corriente o fondo de rotación

UNIDAD DIDÁCTICA 2. ANÁLISIS PATRIMONIAL DE LAS CUENTAS ANUALES

- 1.Cuentas anuales
- 2.Balance de Situación
- 3.Cuenta de pérdidas y ganancias
- 4.Fondo de maniobra

UNIDAD DIDÁCTICA 3. ANÁLISIS FINANCIERO

- 1.Rentabilidad económica
- 2.Rentabilidad financiera
- 3.Apalancamiento financiero
- 4.Ratios de liquidez y solvencia
- 5.Análisis del endeudamiento de la empresa

UNIDAD DIDÁCTICA 4. PROVEEDORES, CLIENTES Y CASH FLOW

- 1.Análisis de los proveedores de la empresa
- 2.Análisis de los clientes de la empresa
- 3.Seguimiento del riesgo por parte de las entidades financieras

UNIDAD DIDÁCTICA 5. ANÁLISIS DEL ESTADO DE FLUJO DE EFECTIVO

- 1.El estado de flujos de efectivo
- 2.Flujos de efectivo de las actividades de explotación
- 3.Flujos de efectivo de las actividades de inversión
- 4.Flujos de efectivo de las actividades de financiación

UNIDAD DIDÁCTICA 6. EL SISTEMA FINANCIERO

- 1.Introducción al Sistema Financiero
- 2.Fuentes de financiación

MÓDULO 8. PROYECTO FIN DE MÁSTER

+ Información Gratis