



Práctica

Proyecto de aula: artículo sobre cuantificación del valor en riesgo de un portafolio de inversión

Profesor: Fredy Ocaris Pérez Ramírez

foperez@udem.edu.co

Programa académico

Ingeniería Financiera y Maestría en Finanzas

Objetivo

Desarrollar habilidades de escritura científica sustentadas en el resultado de un análisis cuantitativo y que aplique los conceptos de econometría financieros (modelos Arima y de volatilidad heterocedástica).



Resumen

Los estudiantes integran conocimientos del programa de Ingeniería Financiera con el uso de herramientas del Laboratorio Financiero como la plataforma Bloomberg, Risk Simulator, Eviews y @Risk. Se realiza la estructuración de un portafolio dinámico a partir de simulaciones que representan el comportamiento de activos financieros (reales) y se estima el valor en riesgo, al igual que las pruebas de *back testing*. Los resultados se presentan a manera de artículo de investigación con defensa. El valor agregado de esta práctica es la integración de los conceptos base de la carrera hasta el octavo semestre y los conocimientos adquiridos en la maestría.