



## ▪ **Excel para los Mercados Financieros y las Finanzas**

FA.25.06

ÁREA DE FINANZAS APLICADAS

Barcelona, del 4 al 14 de Julio del 2011

---

### **Objetivos**

El objetivo de este curso es facilitar a los asistentes el uso de la hoja de cálculo Excel para un gran número de aplicaciones en finanzas.

Se describirá la funcionalidad de Excel™ para operaciones de matemática financiera como el descuento, la valoración, préstamos y créditos y otras utilidades financieras y aplicaciones de gran utilidad en la previsión de mercados e instrumentos financieros.

Se utilizarán tanto las funciones estándares de Excel™ como el desarrollo con herramientas avanzadas y macros.

Los asistentes acabarán el curso con una seguridad y destreza importante en el uso financiero de Excel™.

### **Participantes**

Todos aquellos profesionales financieros y estudiantes de últimos cursos universitarios que deseen mejorar su capacidad de uso de Excel para su trabajo o proyectos.

## **Programa**

### **1. Entorno de trabajo de Excel**

- Entorno de trabajo. Configurar y personalizar Excel.
- Optimizar el uso de hojas, rangos y celdas. Formatos, referencias y nombre.
- Formulas de funciones básicas complementarias. Búsqueda y condicionales. Implantación de funciones. Formulas matriciales.
- Creación, modificación y uso de gráficos. Gráficos dinámicos.
- Tablas, listados, filtros y base de datos. Introducción a las tablas dinámicas.
- Consolidar y validar datos. Formato condicional.
- Vinculación e integración con otras aplicaciones.
- Uso de botones y controles en las hojas de cálculo.
- Trabajo con funciones y formulas en modelos financieros.

### **2. Métodos cuantitativos para las finanzas mediante Excel**

- Estadística Básica
  - Medidas de síntesis.
  - Aplicaciones con Microsoft®Excel: Macro Funciones
  - Aplicaciones mediante la Macro: Herramientas de Análisis.
- Modelos de Probabilidades aplicadas a las finanzas.
  - Aplicaciones con Microsoft®Excel: Macrofunciones
- Contraste de Hipótesis
  - Aplicaciones con Microsoft®Excel: Macrofunciones
  - Aplicaciones mediante al Macro: Herramientas de Análisis.
- Análisis de Series temporales
  - Aplicaciones mediante la Macro: Herramientas de Análisis.
- Correlación y Modelos causales.
  - Aplicaciones con Microsoft®Excel: Macrofunciones
  - Aplicaciones mediante la Macro: Herramientas de Análisis.
- Herramientas Avanzadas.
  - Macro Solver: Modelos de Optimización.
  - Macro @Risk: Herramientas de Simulación

### **3. Matemática financiera para las finanzas mediante Excel™**

- Metodología de las funciones financieras de Excel
- Valoración de productos financieros simples (IPF, Cuentas Corrientes, Letras del Tesoro, Efectos comerciales/Pagarés de empresa, etc.)
- Valoración a interés compuesto
  - Capitalización: Valor final
  - Actualización: Valor actual

- Interés efectivo anual
- TAE
- Valoración de productos financieros complejos
  - Planes de Pensiones/Jubilación
  - Viabilidad de proyectos de inversión
  - Bonos y Obligaciones del Estado
  - Préstamos y créditos

#### 4. Desarrollo de soluciones en Visual Basic Applications (VBA) (Macros de Excel™)

- Entorno de programación
  - Introducción
  - Editor de VBA
  - Objetos de Excel
- Lenguaje VBA:
  - Objetos, propiedades y métodos
  - Construcción de las primeras Macros
  - Construcción de las primeras funciones
  - Uso y definición de variables
  - Estructuras de control (*for, while, if...*)
  - Generación automática de código: interpretación.
- Ejemplos
  - VBA y los métodos cuantitativos; Implementación de simulación MonteCarlo.
  - VBA y las funciones propias de Excel; uso y manipulación de las funciones.
  - VBA y el entorno Excel; personalización de la aplicación.

El curso se desarrollará en el aula de informática.

## Profesorado

**Xavier Nicolás**

Informática de gestión, Licenciado en Investigación y Técnicas de Mercado, UB

**Francesc Ortí**

Profesor titular, UB  
Colaborador académico, IEF

**Jordi Planagumà**

Trader de Derivados

**José Sáez**

Director del Programa CEFA CIIA, IEF

**Salvador Torra**

Profesor de Métodos Cuantitativos, UB  
Colaborador académico, IEF

## Requisitos

La inscripción al Curso se rige por las condiciones internas de admisión. El abono del curso se tendrá que realizar con antelación. La no asistencia se notificará al IEF dos días antes del inicio del curso, como mínimo. En caso contrario se tendrá que abonar el 100% del importe.

La certificación de superación y aprovechamiento del curso puede estar condicionada a algún tipo de prueba previa y, en todo caso, a la asistencia mínima a un 75% de las horas lectivas.

---

## Inscripción

575 euros

(Incluye documentación y *coffee-breaks*)

## Fechas

4, 5, 6, 7, 11, 12, 13 y 14 de julio

## Horario

De 17:30 a 20:30 h

## Duración

24 horas

## Lugar

Aulas del IEF  
Gran Vía, 670  
08010 Barcelona

---

## Información e inscripciones

Gran Vía, 670, 2n

08010 Barcelona

Tel: 93-412.44.31

Fax: 93-412.10.15

E-mail: [infoief@iefweb.org](mailto:infoief@iefweb.org)

Web: [www.iefweb.org](http://www.iefweb.org)

---