



## ▪ **Excel per als Mercats Financers i les Finances**

FA.25.06

ÀREA DE FINANCES APLICADES

Barcelona, del 4 al 14 de juliol del 2011

---

### **Objectius**

L'objectiu d'aquest curs és facilitar als assistents l'ús del full de càlcul Excel per a un gran nombre d'aplicacions en finances.

Es descriurà la funcionalitat d'Excel™ per a operacions de matemàtica financera com el descompte, la valoració, préstecs i crèdits i altres utilitats financeres i aplicacions de gran utilitat en la previsió de mercats i instruments financers.

S'utilitzaran tant les funcions estàndards d'Excel™ com el desenvolupament amb eines avançades i macros.

Els assistents acabaran el curs amb una seguretat i destresa important en l'ús financer de l'Excel™.

### **Participants**

Tots aquells professionals financers i estudiants de darrers cursos universitaris que desitgin millorar la seva capacitat d'ús d'Excel per a la seva feina o projectes.

## **Programa**

### **1. Entorn de treball d'Excel**

- Entorn de treball. Configurar i personalitzar Excel.
- Optimitzar l'ús de fulls, rangs i celes. Formats, referències i noms.
- Fórmules de funcions bàsiques complementàries. Recerques i condicionals. Implantació de funcions. Fórmules matricials.
- Creació, modificació i ús de gràfics. Gràfics dinàmics.
- Taules, llistats, filtres i bases de dades. Introducció a les taules dinàmiques.
- Consolidar i validar dades. Format condicional.
- Vinculació i integració amb altres aplicacions.
- Ús de botons i controls en els fulls de càlcul.
- Treball amb funcions i fórmules en models financers

### **2. Mètodes quantitius per a les finances mitjançant Excel**

- Estadística Bàsica
  - Mesurades de síntesi.
  - Aplicacions amb Microsoft®Excel: MacroFuncions
  - Aplicacions mitjançant la Macro: Eines d'Anàlisi.
- Models de Probabilitat aplicats a les finances
  - Aplicacions amb Microsoft®Excel: MacroFuncions
- Contrast d'Hipòtesi
  - Aplicacions amb Microsoft®Excel: MacroFuncions
  - Aplicacions mitjançant la Macro: Eines d'Anàlisi.
- Anàlisi de Sèries temporals
  - Aplicacions mitjançant la Macro: Eines d'Anàlisi.
- Correlació i Models causals.
  - Aplicacions amb Microsoft®Excel: MacroFuncions
  - Aplicacions mitjançant la Macro: Eines d'Anàlisi.
- Eines Avançades.
  - Macro Solver: Models d'Optimització.
  - Macro @Risk: Eines de Simulació

### **3. Matemàtica financera per a les finances mitjançant Excel™**

- Metodologia de les funcions financeres d'Excel
- Valoració de productes financers simples (IPF, Comptes Corrents, Lletres del Tresor, Efectes comercials/Pagarés d'empresa, etc.)
- Valoració a interès compost
  - Capitalització: Valor final
  - Actualització: Valor actual
  - Interès efectiu anual
  - TAE
- Valoració de productes financers complexos
  - Plans de Pensions/Jubilació
  - Viabilitat de projectes d'inversió
  - Bons i Obligacions de l'Estat
  - Préstecs i crèdits

#### 4. Desenvolupament de solucions en Visual Basic Applications (VBA) (Macros d'Excel™)

- Entorn de programació
  - Introducció
  - Editor de VBA
  - Objectes d'Excel
- Llenguatge VBA:
  - Objectes, propietats i mètodes
  - Construcció de les primeres Macros
  - Construcció de les primeres funcions
  - Ús i definició de variables
  - Estructures de control (*for, while, if...*)
  - Generació automàtica de codi: interpretació.
- Exemples
  - VBA i els mètodes quantitativs; Implementació de simulació MonteCarlo.
  - VBA i les funcions pròpies d'Excel; ús i manipulació de les funcions.
  - VBA i l'entorn Excel; personalització de l'aplicació.

El curs es desenvoluparà en l'aula informàtica.

### Professorat

#### **Xavier Nicolás**

Informàtica de gestió, Llicenciat en Investigació i  
Tècniques de Mercat, UB

#### **Francesc Ortí**

Professor titular, UB  
Col·laborador acadèmic, IEF

#### **Jordi Planagumà**

Trader de Derivats

#### **José Sáez**

Director del Programa CEFA CIIA, IEF

#### **Salvador Torra**

Professor de Mètodes Quantitatius, UB  
Col·laborador acadèmic, IEF

### Requisits

La inscripció al Curs es regeix per les condicions internes d'admissió. L'abonament s'haurà de realitzar amb antelació. La no assistència es notificarà a l'IEF dos dies abans de l'inici del curs, com a mínim. En cas contrari s'haurà d'abonar el 100% de l'import.

La certificació de superació i aprofitament del curs pot estar condicionada a algun tipus de prova prèvia i, en tot cas, a l'assistència mínima a un 75% de les hores lectives.

### Inscripció

575 euros

(Inclou documentació i *coffee-breaks*)

### Dates

4, 5, 6, 7, 11, 12, 13 i 14 de juliol

### Horari

De 17:30 a 20:30 h

### Durada

24 hores

### Lloc

Aules de l'IEF  
Gran Via, 670  
08010 Barcelona

---

### Informació i inscripcions

Gran Via, 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)

---