



Descriptivo

Selección Estratégica de Carteras: El Caso de Carteras Multi-divisa, con Activos de Renta Fija y Variable.

Descripción:

El taller enfoca, desde una perspectiva práctica, cómo extender el modelo clásico de optimización de carteras para incorporar tanto inversiones de renta fija como renta variable y considerar activos en múltiples monedas



Dirigido a:

Este taller está dirigido a analistas financieros, consultores de inversiones y riesgos, reguladores, docentes y estudiantes de economía, finanzas y negocios entre otros, interesados en conocer nuevos modelos y herramientas prácticas para identificar y evaluar carteras de inversión óptimas.



Objetivo:

Conocer los fundamentos teóricos y aspectos prácticos del proceso de optimización estratégica de carteras de inversión en múltiples monedas.

Comprender por qué y de qué modo es necesario cambiar la estructura del modelo para incorporar inversiones en instrumentos de renta fija.

Entender el cálculo de sensibilidades vectoriales ante factores de riesgo.



Temario:

- El modelo clásico de Media-Varianza (MVO)
- Activos primitivos vs. Activos valorizados
- El cálculo del rentabilidad y riesgo con las dos clases de activos
- Cómo estimar sensibilidades vectoriales con respecto a factores de riesgo
- Aplicación del modelo MVO extendido empleando MS Excel y OptiFolio Academic



Instructores: