



Descriptivo

# Taller Didáctico Presencial: Selección de Carteras de Inversión con Risk Simulator y OptiFolio

## Descripción:

Presentación gratuita vía online donde los participantes podrán acercarse a la teoría moderna de selección de carteras de inversión con dos sesiones. La primera sesión, tratará el enfoque tradicional de media y varianza de Markowitz, y la segunda sesión, utilizará el modelo CAPM (Capital Asset Pricing Model). En cada una de las metodologías se seleccionará carteras de inversión bajo algunos criterios de utilidad esperada.



### Dirigido a:

Profesionales, docentes, estudiantes y en general a todas las personas que estén interesadas en aprender los fundamentos para la optimización de carteras de inversión con el apoyo de herramientas informáticas como Risk Simulator y OptiFolio



### Objetivo:

1. Revisar de los conceptos teóricos para la optimización de carteras de inversión
2. Construir modelos en Excel para la optimización y selección de carteras.
3. Utilizar Risk Simulator y OptiFolio para mejorar la eficiencia en la gestión de carteras



### Temario:

1. Introducción teórica para la selección de carteras de inversión.
2. Cálculo del Riesgo de la cartera a partir de la matriz de varianzas y covarianzas.
3. Optimización de carteras con el uso de parámetros de distribución.
4. Construcción de la frontera eficiente.
5. Optimización de carteras con rendimientos simulados.
6. Uso del modelo CAPM para la optimización de carteras.
7. Selección de carteras de inversión: Índice de Sharpe, Utilidad Esperada del Inversionista y Omega de Keating.



### Instructores: