

Webcast

Nuevos Enfoques y Modelos para la Optimización y Análisis de Riesgo en Carteras de Inversión.

Descripción

El taller enfoca, desde una perspectiva práctica, el uso de herramientas y modelos recientes para formular prudentemente carteras de inversión óptimas y evaluar su desempeño.

Dirigido a

Este taller está dirigido a analistas y consultores de inversiones y riesgos, reguladores, docentes y estudiantes de Economía, Finanzas y Negocios interesados en conocer los modelos y herramientas más recientes para formular carteras de inversión óptimas y evaluar su desempeño.

Objetivo

Conocer los fundamentos teóricos y aspectos prácticos del proceso de optimización de carteras empleando indicadores de riesgo clásicos (simétricos) y modernos (asimétricos). Comprender la importancia y mecanismos para fijar límites de posición y exposición en carteras de inversión. Entender el uso del indicador Omega(TM), la aplicación de benchmarks y la proyección Monte-Carlo en el contexto de análisis de carteras de inversión.

Temario

Optimización y análisis de riesgo de carteras de inversión

El modelo clásico de Media-Varianza (MVO)

El modelo de Valor-en-Riesgo Condicional (CVaR)

El indicador Omega(TM) de rentabilidad ajustada por riesgo

La incorporación de restricciones de posición en el análisis

Uso de carteras benchmark: restricciones de turn-over

Descomposición de riesgo mediante el Contribution VaR. Proyección de valor de carteras mediante análisis Monte-Carlo

Análisis de desempeño mediante el modelo de Brinson

Instructores

Roddy Rivas-Llosa

Licenciado en Economía y Magíster en Finanzas de la Universidad del Pacífico en Perú, con estudios de Especialización en Ingeniería Financiera en la Universidad de Harvard y la designación CFA Charterholder (USA). Se ha desempeñado como docente durante más de veinte años y ha sido autor de dos libros sobre Econometría y Finanzas. Actualmente es Director del Master in Management de la Pacífico Business School y

representante de las Administradoras de Fondos de Pensiones del Perú ante la Superintendencia de Banca, Seguros y AFP. Adicionalmente, es socio de Innova Factoring, una empresa Fintech.

Información General

Duración

Una hora

Fecha de Inicio

Jue. 04 de Dic de 2014

Horarios

San José de Costa Rica 10:00 a.m

México D.F. 10:00 a.m

Bogotá 11:00 a.m

Quito 11:00 a.m

Lima 11:00 a.m Caracas 11:30 a.m

Bolivia 12:00 m

Buenos Aires 1:00 p.m

Santiago 1:00 p.m

Herramientas de apoyo

Políticas

Para conocer en detalle las condiciones y políticas de participación en los eventos, ingrese a nuestro link
<https://www.software-shop.com/formacion/politicas>

Inscríbete ahora