Webcast

Uso Intregrado de Excel: Aplicación Básica para la Optimización de Portafolios de Inversión

Descripción

Sin importar cuál sea nuestra disciplina de conocimiento o en qué área de trabajo nos desempeñemos, es poco probable que no hayamos siquiera digitado algunos cuántos números en MS Excel; es por esto, que en esta oportunidad se realizará una aplicación de las herramientas básicas de MS Excel para simular la gestión de un portafolio de inversión con acciones colombianas con el fin de ilustrar sus principios básicos tanto a nivel teórico como práctico.

Dirigido a

Profesionales, docentes, investigadores, estudiantes y en general a todas las personas que trabajen o estén interesadas en aprender - repasar las principales funcionalidades de uno de los programas más versátiles para el análisis de información cuantitativa: MS Excel

Objetivo

Revisar algunas funcionalidades MS Excel a través de un ejemplo de formación y optimización de un portafolio de inversión con acciones colombianas con las herramientas que nos ofrece MS Excel.

Temario

Introducción: Teoría Moderna de Portafolios

- Markowitz
- Portafolio Eficiente
- Frontera Eficiente

Optimización de Carteras

- Riesgo
- Varianza y Desviación Estándar
- Retorno E y Diversificación
- Matriz Varianza Covarianza
- Solver
- Coeficiente de Sharpe

Instructores

Andrés Raúl Cruz Hernández

Profesional en Finanzas y Comercio Internacional de la Universidad de La Salle. Magíster en Investigación en Administración (énfasis en finanzas) y Doctor en Administración de la Universidad de los Andes. Acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgos Cuantitativos CQRM. Actualmente es profesor de la Escuela de Negocios del Tecnológico de Monterrey y hace parte de nuestro grupo de especialistas certificados Next-Gen.

Información General

Duración
1 Hora

Fecha de Inicio
Vie. 20 de Mar de 2015

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

Risk Simulator

Excel

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