

# Webcast

## 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 de la 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

#### 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

1 Hora

## Fecha de Inicio

Jue. 04 de Jun de 2015

## Horarios

San José de Costa Rica 10:00 a.m

México D.F. 11:00 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