

Webcast

Modelo de Atribución de Desempeño de una Cartera Respecto a Benchmarks con Optifolio

Descripción

Sin importar cuál sea nuestra disciplina de conocimiento o en qué área de trabajo nos desempeñemos, es importante que conozcamos herramientas para gestionar el dinero que manipulamos de manera constante (nuestros ahorros personales, familiares o el capital de alguna empresa); es por esto, que en esta oportunidad se realizará una aplicación de la herramienta de Optifolio para simular la gestión de un portafolio de inversión con títulos de renta variable con el fin de ilustrar sus principios básicos tanto a nivel teórico como práctico, analizando distintas políticas de inversión utilizando un modelo de atribución de desempeño con respecto a un Benchmark.

Dirigido a

Profesionales, docentes, investigadores, estudiantes y en general a todas las personas que estén interesadas en aprender las principales funcionalidades de un nuevo software para la gestión de portafolios de inversión: Optifolio.

Objetivo

Evaluar distintas políticas de inversión utilizando un modelo de atribución de desempeño con respecto a un Benchmark. Ilustrar de manera práctica la formación y optimización de un portafolio de inversión con acciones del mercado de valores utilizando la herramienta de Optifolio. Revisar las principales funcionalidades de Optifolio para el análisis cuantitativo de información, manejo de información, Restricciones, Administración del portafolio, etc. Repasar, cuando sea necesario, los aspectos conceptuales relevantes para entender la aplicación de la herramienta. Por ejemplo: Teoría Moderna de Portafolios, Diversificación de riesgo.

Temario

Introducción a Optifolio

- Manejo de información
- Optimización de Portafolio
- Restricciones
- Administración del Portafolio

Presentación teórica sobre modelos de atribución de desempeño

- Brinson
- Benchmark

Instructores

Andrés Raúl Cruz Hernández

Instructor del Portafolio - Riesgo y Finanzas en Software Shop. Profesional en Finanzas y Comercio Internacional de la Universidad de La Salle. Magíster en Investigación en Administración (énfasis en finanzas) de la Universidad de los Andes. Acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgos Cuantitativos CQRM, actualmente adelanta estudios de Doctorado en Administración en la Universidad de los

Andes, Colombia. .

Información General

Duración

1 Hora

Fecha de Inicio

Vie. 23 de Oct 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