

# Webcast

## Gestione de Manera Óptima Portafolios de Inversión con OptiFolio Pro

### Descripción

La presentación enfoca desde una perspectiva práctica el uso de herramientas y modelos recientes para formular prudentemente carteras de inversión óptimas incluyendo factores de riesgo de mercado.

### Dirigido a

Comisionistas, Administradoras de Fondos de Pensiones y Cesantías, Fideicomisos, Universidades y personas que estén interesadas en una herramienta práctica que permita optimizar y analizar el riesgo de portafolios de inversión aplicando tanto modelos tradicionales como de última generación, e incluir el efecto de factores de riesgo de mercado (como tipos de cambio y tasas de interés).

### Objetivo

Conocer los fundamentos teóricos y aspectos prácticos del proceso de optimización de carteras empleando indicadores de riesgo clásicos (simétricos) y modernos (asimétricos). Mostrar al participante la manera eficiente de construir y gestionar carteras de inversión en una situación real de mercado donde el análisis de activos ilíquidos o de bonos sensibles a múltiples tramos de curva de tasas se hacen relevantes en la conformación de portafolios. Explicar los fundamentos y aplicación del modelo de Black Litterman para la inclusión de puntos de vista del inversionista sobre el desempeño esperado del mercado.

### Temario

- El modelo clásico de Media-Varianza (MVO).
- El modelo de Valor-en-Riesgo Condicional (CVaR).
- El indicador Omega de rentabilidad ajustada por riesgo.
- Descomposición de riesgo mediante el Contribution VaR. Proyección de valor de carteras mediante análisis Monte-Carlo.
- Análisis de desempeño mediante el modelo de Brinson.
- Incorporar Factores Riesgo de Mercado en el proceso de Optimización.
- Perspectivas del inversionista y el modelo de Black-Litterman.

### 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. 22 de Sep de 2016

## Horarios

San José de Costa Rica 9:00 a.m

México D.F. 10:00 a.m

Bogotá 10:00 a.m

Quito 10:00 a.m

Lima 10:00 a.m

Caracas 10:30 a.m

Bolivia 11:00 a.m

Buenos Aires 12:00 m

Santiago 12:00 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