

# Webcast

## Sesión 1: Selección de Carteras de Inversión con Risk Simulator y OptiFolio

### Descripción

Presentación gratuita vía online donde los participantes podrán acercarse a la teoría moderna de selección de carteras de inversión con dos sesiones. La primera sesión, tratará el enfoque tradicional de media y varianza de Markowitz, y la segunda sesión, utilizará el modelo CAPM (Capital Asset Pricing Model). En cada una de las metodologías se seleccionará carteras de inversión bajo algunos criterios de utilidad esperada.

### Dirigido a

Profesionales, docentes, estudiantes y en general a todas las personas que estén interesadas en aprender los fundamentos para la optimización de carteras de inversión con el apoyo de herramientas informáticas como Risk Simulator y OptiFolio

### Objetivo

Repasar los conceptos teóricos para la optimización de carteras de inversión  
Construir modelos en Excel para la optimización y selección de carteras.  
Utilizar Risk Simulator y OptiFolio

### Temario

Introducción teórica para la selección de carteras de inversión.  
Cálculo del Riesgo de la cartera a partir de la matriz de varianzas y covarianzas.  
Optimización de carteras con el uso de parámetros de distribución.  
Construcción de la frontera eficiente.  
Optimización de carteras con rendimientos simulados.  
Uso del modelo CAPM para la optimización de carteras.  
Selección de carteras de inversión: Índice de Sharpe, Utilidad Esperada del Inversionista y Omega de Keating.

### Instructores

#### **Miguel Ángel Bello Bernal, Mag.**

Economista de la Universidad de la Salle y MBA de la Universidad Villanueva en España. Actualmente, está acreditado con la Certificación Internacional en Gestión de Riesgos-CQRM impartida por el Dr. Johnathan Mun. Consultor y formador especialista en Software Shop. Profesor de estadística, econometría y analítica de datos, a nivel de pregrado y posgrado en el Colegio de Estudios Superiores de Administración (CESA) y otras universidades de Colombia. Cuenta con 7 años de experiencia como conferencista y capacitador internacional en análisis de riesgo y métodos cuantitativos para mejorar la toma de decisiones bajo escenarios de incertidumbre.

# Información General

## Duración

1 Hora

## Fecha de Inicio

Jue. 24 de Nov de 2016

## Horarios

San José de Costa Rica 9:00 a.m

México D.F. 9:00 a.m

Bogotá 10:00 a.m

Quito 10:00 a.m

Lima 10:00 a.m Caracas 11:00 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