

Webcast

Estrategias Óptimas de Inversión Multidivisa Empleando OptiFolio Pro

Descripción

El taller 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

1. Conocer los fundamentos teóricos y aspectos prácticos del proceso de optimización de carteras empleando indicadores de riesgo clásicos (simétricos) y modernos (asimétricos)
2. Mostrar al participante la manera eficiente de construir y gestionar carteras de inversión en una situación real de mercado donde se requiere el análisis de activos denominados en múltiples monedas.
3. Explicar los fundamentos y aplicación del modelo factorial de revalorización de activos, base conceptual para la inclusión de factores de riesgo en la formación de cartera.

Temario

- El modelo clásico de formación de cartera versus en enfoque moderno de riesgo asimétrico.
- ¿Qué son los factores de riesgo de mercado y cómo incorporarlos en el análisis de cartera?
- El caso de inversiones en múltiples monedas: modelo base y modelo mejorado.
- Inclusión de las perspectivas del inversionista sobre el desempeño futuro de factores, activos y carteras.

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. 06 de Abr de 2017

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 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