Webcast

Estrategias óptimas de inversión con bonos soberanos y corporativos 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 instrumentos de renta fija.

Dirigido a

Administradoras de Fondos de Pensiones y Cesantías, Fideicomisos, Comisionistas, Analistas financieros, Universidades y personas que estén interesadas en una herramienta práctica para 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

- Detallar los fundamentos teóricos y aspectos prácticos del proceso de valorización y sensibilización de instrumentos de renta fija.
- Distinguir entre los riesgos de flujo de caja y de revalorización en el contexto de gestión de carteras.
- Mostrar cómo construir carteras de inversión óptimas que incluyan instrumentos de renta fija, considerando los factores relevantes de riesgo y rentabilidad.

Temario

- Instrumentos de renta fija: características clave en el marco de los modelos de optimización de carteras.
- Riesgo de flujo de caja versus riesgo de revaluación.
- Cálculo de sensibilidades con respecto a factores de riesgo de mercado.
- Incorporación de bonos en el modelo de optimización de carteras de inversión.

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. 25 de May 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 11:00 a.m.

Herramientas de apoyo

OptiFolio

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