

Webcast

Aplicaciones Financieras del Modelo CAPM: Cálculo del WACC y construcción de Portafolios de Inversión

Descripción

El taller mostrará el modelo fundamental para la valoración de acciones, CAPM. Mostrará una muy breve descripción teórica y la aplicación mediante el análisis de regresión usando para este fin el software MS.Excel y Risk Simulator. Se abordarán dos aplicaciones del modelo: calcular el WACC y la matriz de varianzas y covarianzas para la construcción de portafolios de inversión.

Dirigido a

Dirigido a personas interesadas en el manejo de información y análisis de datos económicos y financieros, ya sean estudiantes, profesores, profesionales o investigadores que deseen aprender o actualizarse en el manejo de herramientas informáticas. Las áreas de interés a las cuales va dirigida esta presentación son: Análisis Económico y Financiero, Proyectos de inversión, Análisis de Inversiones, Gestión de Portafolios, Análisis y Gestión de Riesgos, Econometría.

Objetivo

- Llevar al participante de una manera muy simple a realizar una aplicación financiera del análisis de regresión, presentando los conceptos teóricos básicos y herramientas más importantes.
- Aplicar el modelo CAPM para calcular el Weighted Average Cost of Capital (WACC) y utilizarlo como insumo para la valoración de proyectos de inversión.
- Aplicar el modelo CAPM para calcular el riesgo total y de mercado de un activo financiero, así como también la construcción de la matriz de varianzas y covarianzas, insumo para la optimización de portafolios de inversión.

Temario

1. Uso de la regresión para el modelo CAPM
 - a. Betas
 - b. Riesgo de Mercado
 - c. Riesgo Especifico
 - d. Riesgo de Mercado
2. Calcular el WACC a partir del modelo CAPM
3. Construcción de la matriz de varianzas y covarianzas a partir del modelo CAPM

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

Mie. 06 de Dic de 2017

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

Santiago 12:00 m

Buenos Aires 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