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

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 analitica 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

Risk Simulator

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