

Webcast

Estrategias para la Construcción y Valoración de Portafolios de Inversión

Descripción

Presentación vía web donde se mostrará 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.

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.

Temario

1. Estrategias de Inversión.
2. Teoría Moderna de Portafolio.
 - a. Función de Utilidad
 - b. Cálculo de rentabilidad y riesgo.
 - c. Cálculo de covarianzas y correlaciones entre activos.
 - d. Frontera Eficiente.
3. Principales indicadores estratégicos de inversión.
 - a. Índice de Sharpe.
 - b. Omega de Keating.
 - c. Función de utilidad del inversionista.
 - d. Value at Risk (VaR).
 - e. Conditional Value at Risk (CVaR).

Instructores

Franco Andrés Mansilla Ibañez

Ingeniero Civil Industrial con Magister en Finanzas en la Universidad de Chile. Actualmente, se encuentra trabajando como Líder Técnico en Inteligencia Artificial en el Banco de Crédito e Inversiones - BCI. Se ha desempeñado como Analista en Investigación Económica y Financiera para académicos de la Universidad de Chile y Banco Central de Chile en temas de Mercados de Capitales, Eficiencia de Mercado, Riesgo Financiero, Econometría y Estadística. En el área académica ha sido catedrático en temas como: Probabilidad y Estadística, Econometría Financiera, Formulación y Evaluación de Proyecto, y en ramas de ingeniería como Investigación de Operaciones y Taller de Ingeniería Civil Industrial.

Información General

Duración

1 Hora

Fecha de Inicio

Jue. 24 de May de 2018

Horarios

San José de Costa Rica 8:00 a.m

México D.F. 9:00 a.m

Bogotá 9:00 a.m

Quito 9:00 a.m

Lima 9:00 a.m

Caracas 10:00 a.m

Bolivia 10:00 a.m

Santiago 10:00 a.m

Buenos Aires 11:00

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