

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

Especialista en entrega de soluciones analíticas a necesidades y problemáticas del negocio, tal como inversiones, operaciones y riesgos. Académico de la Universidad de Chile en cursos de Riesgo Financiero del Magíster en Finanzas y Métodos Cuantitativo en la gestión de riesgo en el diplomado de Administración de Riesgo. Sus temas de investigación son: eficiencia de mercado, riesgo financiero, machine learning y

econometría.

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