

# Webcast

## Sesión II: Optimización de Portafolios de Inversión en Microsoft Excel y Risk Simulator

### Descripción

En este webcast se abordarán los conceptos y procedimientos necesarios para la construcción idónea de modelos de optimización de portafolios de inversión teniendo en cuenta la rentabilidad, el riesgo y la correlación presente en los activos financieros.v

### Dirigido a

Analistas financieros, gerentes financieros y de riesgos, consultores financieros, analistas de riesgos, estudiantes de disciplinas financieras, económicas e ingenierías, especialistas en finanzas, y en general a todas aquellas personas interesadas en conocer los conceptos y aplicaciones para la optimización de portafolios de inversión

### Objetivo

Conocer los conceptos y procedimientos necesarios para diseñar e interpretar modelos de optimización construidos con Microsoft Excel y Risk Simulator.

### Temario

#### Construcción de Portafolios

- Introducción a la Teoría de portafolios.
- Modelo de Media y varianza.
- La Diversificación de Markowitz.
- Zona Factible y Frontera Eficiente.
- Índice Sharpe y su importancia.

#### Optimización de portafolios

- ¿Qué es la optimización y por qué es importante?
- Riesgo Vs Rentabilidad
- Características de una optimización
- Optimización estática, dinámica y estocástica.

### Instructores

#### Wilmer Ramírez

Ingeniero financiero de la Universidad Piloto de Colombia, acreditado con la Certificación Internacional en Administración Cuantitativa de Riesgos CQRM, con formación en Bloomberg, auditoría interna ISO 9001, NIC (Normas Internacionales de Contabilidad) y NIIF (Normas Internacionales de Información Financiera). Cuenta con experiencia en solución de problemas en áreas administrativas, contables y financieras en empresas del sector real y estatal. Actualmente se desempeña como instructor especializado del área de Riesgo y Finanzas en Software Shop

# Información General

## Duración

1 Hora

## Fecha de Inicio

Vie. 15 de Jun de 2018

## Horarios

10:00 a.m San José de Costa Rica

11:00 a.m CDMX - Bogotá - Quito - Lima - Caracas

12:00 m La Paz - Santiago

01:00 p.m Buenos Aires

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