

Webcast

Gestión Moderna 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 portafolios de inversión incluyendo factores de riesgo de mercado y análisis estadístico.

Dirigido a

Comisionistas, Administradoras de Fondos de Pensiones y Cesantías, Fideicomisos, Mesas de Dinero, estudiantes y profesores de carreras como administración de empresas, economía, finanzas, ingenierías y personas que estén interesadas en conocer de manera práctica el proceso de gestión de portafolios de inversión.

Objetivo

1. Conocer los fundamentos teóricos y aspectos prácticos del proceso de optimización de portafolios empleando indicadores de riesgo clásicos (simétricos) y modernos (asimétricos).
2. Mostrar al participante la manera eficiente de construir y gestionar portafolios de inversión en una situación real de mercado.

Temario

1. Estrategias de Inversión.

- Enfoque Ingenuo.
- Enfoque por Riesgo.
- Enfoque por Riesgo y Correlación.

2. Teoría Moderna de Portafolio.

- Función de Utilidad.
- Cálculo de rentabilidad y riesgo.
- Cálculo de covarianzas y correlaciones entre activos.
- Frontera eficiente y línea de asignación de capital (CAL)

3. Principales indicadores estratégicos de inversión

- Índice de Sharpe.
- Utilidad del inversionista.
- Omega de Keating.
- Value at Risk (VaR) vs 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. 07 de Mar de 2019

Horarios

08:00 a.m San José de Costa Rica - CDMX

09:00 a.m Bogotá - Quito - Lima

10:00 a.m La Paz - Caracas

11:00 a.m Buenos Aires - Santiago de Chile

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