

Webcast

Construcción y optimización de portafolios de inversión

Descripción

La gestión de portafolios y la optimización de estrategias de inversión son procesos fundamentales para quienes administran recursos, evalúan riesgos y toman decisiones financieras. Para ello, es indispensable el uso de herramientas analíticas que permitan un análisis riguroso y confiable. En este contexto, Risk Simulator, integrado a Microsoft Excel, proporciona un entorno robusto para realizar análisis cuantitativos avanzados mediante simulaciones de Monte Carlo y técnicas de optimización. Este webinar ofrecerá una introducción práctica a la construcción de portafolios eficientes y al análisis de decisiones de inversión basadas en criterios estadísticos y modelos de riesgo.

Dirigido a

Profesionales de banca e inversiones, tesorería, fintech, consultores, estudiantes, profesores y cualquier persona interesada en aprender cómo optimizar portafolios de inversión con apoyo de herramientas analíticas.

Objetivo

Presentar a los participantes las diferentes herramientas estadísticas con las que cuenta Risk Simulator enfocándose en optimización de portafolios de inversión y construcción de la frontera eficiente.

Temario

- Cálculo de la rentabilidad esperada y la volatilidad de un portafolio.
- Estructura de correlaciones y su impacto en la diversificación.
- Uso de simulación para evaluar escenarios de inversión.
- Implementación de restricciones y objetivos en la optimización.
- Portafolio de mínima varianza y portafolio tangente.
- Espacio de preguntas

Instructores

Thomas Dávila Correa

Experto Técnico Next-Gen con formación en economía de la Universidad Militar Nueva Granada. Acreditado con la Certificación Internacional en Gestión Cuantitativa de Riesgos (CQRM) otorgada por el instituto IIPER (International Institute of Professional Education and Research). Participante del grupo de estudios en educación, contabilidad y sociedad, con experiencia en el manejo de herramientas informáticas para el análisis de datos, su aprovechamiento y apoyo en la toma de decisiones.

Información General

Duración

1 hora

Fecha de Inicio

Jue. 28 de Ago de 2025

Horarios

10:00 a.m Costa Rica - México

11:00 a.m Colombia - Ecuador- Perú

12:00 a.m Bolivia - Chile - Venezuela

13:00 Brasil - Argentina

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