

PORTFOLIO MANAGEMENT

SET_{FX}
SISTEMA ELECTRÓNICO DE TRANSACCIÓN DE MONEDA EXTRANJERA



Inicio: 22 de Noviembre de 2010
Colombia, Bogotá

RiskMathics
FINANCIAL INNOVATION

PORTFOLIO MANAGEMENT

RiskMathics, empresa dedicada a la investigación, análisis e impartición de cursos de vanguardia en las áreas de Administración de Riesgos, Trading, Productos Derivados y Finanzas Cuantitativas en conjunto con Integrados FX, filial de la Bolsa de Valores de Colombia organizan el Curso: *Portfolio Management*, el cual es único en su tipo. Este curso está enfocado a los involucrados en los mercados financieros que quieran aprender a construir, administrar y analizar el desempeño de portafolios de inversión que involucren distintos tipos de instrumentos.

Actualmente no existe mucha literatura sobre cómo crear y administrar eficientemente portafolios de inversión que arrojen coeficientes "Alpha" aceptables (rendimientos que estén por arriba de la Tasa Libre de Riesgo) para los Inversoristas que participan en fondos.

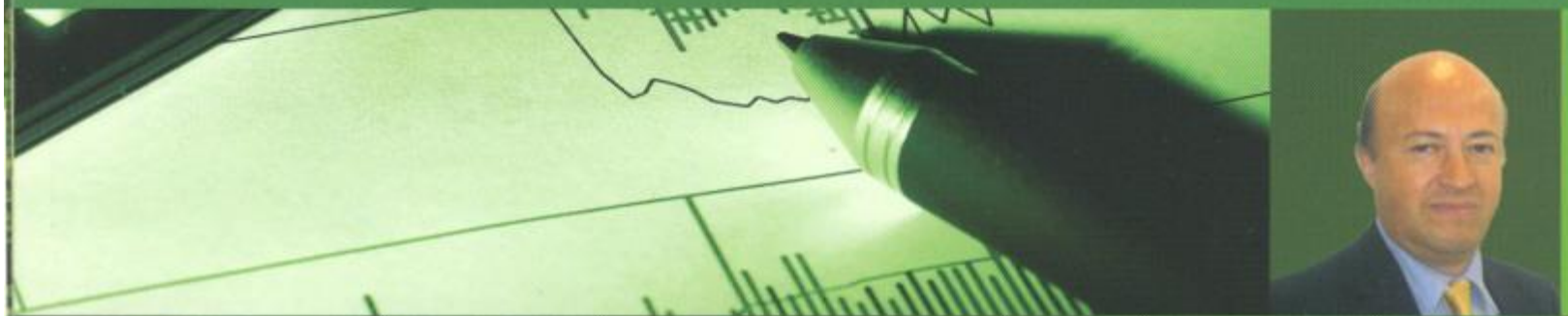
El Curso servirá a los participantes para llevar a cabo mejores e inteligentes estrategias de inversión, principalmente a través de:

1. Definir metas y objetivos de Inversión
2. Identificar, eliminar, minimizar y/o diversificar Riesgos
3. Monitoreo del Portafolio
4. ¿Cuándo o cómo crear determinado tipo de portafolio?, ¿Fondo con Inversión Local o Extranjera?
5. Desempeño del Portafolio

OBJETIVO

Mostrar las bases teóricas y prácticas para la construcción, administración y análisis de las principales clases de portafolios de inversión. Enfocado para:

- Fund Managers
- Traders
- Inversoristas Independientes
- Tesoreros
- Creadores de Fondos y Portafolios de Inversión



Pedro Espinosa
Asset Management

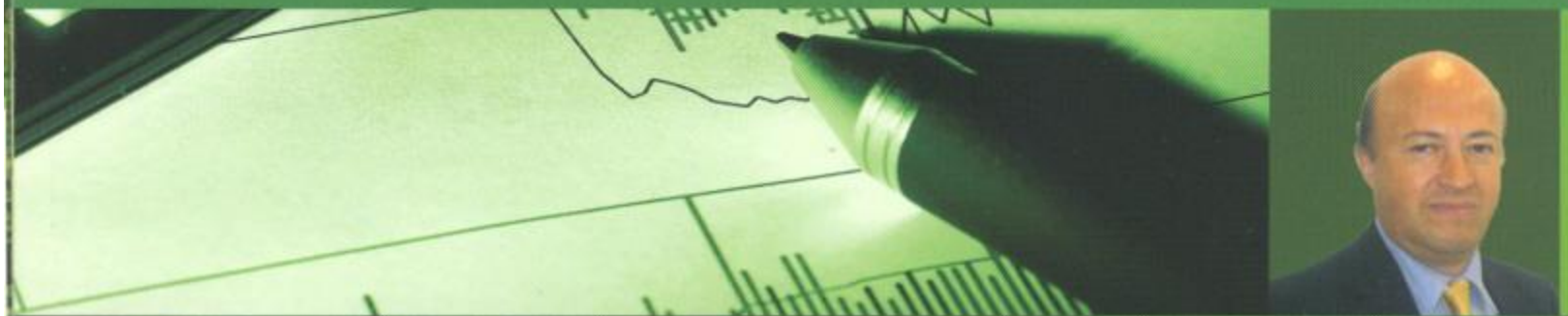
Pedro Espinosa Langle es Director de Asset Management del Grupo Financiero Interacciones. Cuenta con más de 17 años de experiencia en el Sector Financiero, previamente fungió como CIO de Compass Group México y CFO de Afore de la Gente y Afore Allianz-Dresdner. Cuenta con títulos de Maestría en Finanzas y Economía por el Instituto Tecnológico Autónomo de México (ITAM) y por el Centro de Investigación y Docencia Económicas (CIDE). Así como cursos de Alta Dirección en el IPADE.

Duración: 12 Horas

PARTE II

TEMARIO

1. Etapas del proceso de Administración de Portafolios de Inversión.
2. Rendimiento Esperado y riesgo de un portafolio de inversión.
3. Importancia del perfil del inversionista y el Asset Allocation.
4. Estrategias básicas de inversión por escala de riesgo y manejo activo del portafolio.
5. Valuación de bonos y acciones.
6. Definición del Benchmark y Tracking Error.
7. Análisis Fundamental y Técnico en renta fija y renta variable.
8. Estrategias de inversión por valor o crecimiento.
9. Ejercicios prácticos de fronteras eficientes.
10. Portafolios de renta fija.
11. Portafolios de renta variable.
12. Derivados en los portafolios.
13. Monedas y Commodities (ETFs).
14. Portafolios de fondos.
15. Hedge Funds.
16. Visión global de la inversión.
17. Evaluación del desempeño del portafolio.



Pedro Espinosa
Asset Management

Pedro Espinosa Langle es Director de Asset Management del Grupo Financiero Interacciones. Cuenta con más de 17 años de experiencia en el Sector Financiero, previamente fungió como CIO de Compass Group México y CFO de Afore de la Gente y Afore Allianz-Dresdner. Cuenta con títulos de Maestría en Finanzas y Economía por el Instituto Tecnológico Autónomo de México (ITAM) y por el Centro de Investigación y Docencia Económicas (CIDE). Así como cursos de Alta Dirección en el IPADE.

Duración: 12 Horas

PARTE II

TEMARIO

1. Etapas del proceso de Administración de Portafolios de Inversión.
2. Rendimiento Esperado y riesgo de un portafolio de inversión.
3. Importancia del perfil del inversionista y el Asset Allocation.
4. Estrategias básicas de inversión por escala de riesgo y manejo activo del portafolio.
5. Valuación de bonos y acciones.
6. Definición del Benchmark y Tracking Error.
7. Análisis Fundamental y Técnico en renta fija y renta variable.
8. Estrategias de inversión por valor o crecimiento.
9. Ejercicios prácticos de fronteras eficientes.
10. Portafolios de renta fija.
11. Portafolios de renta variable.
12. Derivados en los portafolios.
13. Monedas y Commodities (ETFs).
14. Portafolios de fondos.
15. Hedge Funds.
16. Visión global de la inversión.
17. Evaluación del desempeño del portafolio.



Rubén Téllez Trevilla
Socio Director General

Rubén Téllez es responsable de todos los proyectos de desarrollo, comercialización, instalación y servicio a clientes del Zeus System en México desde el inicio de operaciones de la compañía. Este sistema tiene un amplio reconocimiento y uso en los mercados mexicano y brasileño y es utilizado para la gestión avanzada de portafolios de inversión financiera.

Asimismo, responsable directo de proyectos de consultoría especializada en administración integral de riesgos, con amplio reconocimiento y certificación para el mercado financiero mexicano. Se han desarrollado proyectos de consultoría que van desde la instalación de procesos, tecnología y procedimientos en materia de riesgos financieros, hasta reportes de auditoría en modelos y metodologías de administración de riesgos. Más de 80 proyectos realizados con la mayoría de las principales instituciones financieras mexicanas e internacionales localizadas en México. Entre ellas fondos de pensiones, bancos, casas de bolsa, aseguradoras y afianzadoras.

Duración: 6 Horas

PARTE III

TEMARIO

1. APLICACIONES DE PORTFOLIO MANAGEMENT: OPTIMIZACIÓN Y PERFORMANCE ATTRIBUTION
 - a. Modelos multifactoriales para la gestión del riesgo-rendimiento de portafolios de inversión
 - b. Planteamiento de casos de simulación en escenarios económicos futuros
 - c. Desarrollo e implementación de algoritmos de optimización de portafolios de inversión
 - d. Casos de optimización simple y activa: definición de escenarios para deuda y capitales, definición de restricciones, selección de universo de activos disponibles
 - e. Análisis de frontera eficiente y selección e interpretación de portafolios óptimos
 - f. Construcción de metodologías de performance attribution: algoritmos y parámetros utilizados
 - g. Análisis de casos de performance attribution de riesgos y rendimientos para portafolios y sus benchmarks
 - h. Casos avanzados de optimización y performance attribution
 - i. Gráficas y reportes recomendados para presentación de resultados

INSCRIPCIONES

E-mail: derivatives@riskmathics.com

Tel: (1) 508 71 66

WWW.RISKMATRICS.COM

Duración: 30 horas

**Lugar: Club de Banqueros
(Calle 72 No. 7-64 P.H. edificio
Acciones y Valores)
Colombia, Bogotá**

Costo: \$1500 USD

REQUISITOS:

- Para un óptimo aprovechamiento de este curso se recomienda provenir de carreras de áreas económico-administrativas
- Trabajar en entidades financieras
- Se requerirá de Lap Top

OPCIONES DE PAGO:

1. Transferencia Bancaria en Dólares (RESIDENTES E INSTITUCIONES ESTABLECIDAS EN EL EXTRANJERO)
BANCO: BBVA Bancomer, S.A.
SUCURSAL: 0956
SWIFT: BCMRMXMM
BENEFICIARIO: RiskMathics Financial Innovation, S.C.
CUENTA: 012180001649665629
2. Pago vía telefónica con Tarjeta de crédito VISA, MASTERCARD o AMERICAN EXPRESS



RiskMathics
FINANCIAL INNOVATION

NOTA IMPORTANTE:

No existen reembolsos ni devoluciones.