

Categorías: Administración y gestión

### OBJETIVOS

- Comprender los conceptos y técnicas de la gestión de carteras de inversiones.
- Analizar los riesgos y retornos de diferentes activos y clases de activos.
- Desarrollar estrategias de diversificación y selección de activos eficaces.
- Evaluar y monitorear la performance de la cartera.
- Tomar decisiones informadas sobre el rebalanceo y la asignación de activos en la cartera.
- Aplicar conocimientos y habilidades en la gestión de una cartera real.

### CONTENIDOS

#### Conceptos básicos de estadística

- Media y esperanza
- Varianza y desviación típica
- Covarianza
- Coeficiente de Correlación
- Recta de regresión

#### Riesgo y marco de rendimiento

- Rendimiento de un activo
- Rendimiento de una cartera
- Volatilidad de un activo
- Riesgo de una cartera de valores
- El concepto de diversificación
- Supuesto de hipótesis de normalidad

#### Mercados de capital eficientes

- El concepto de eficiencia en los mercados de capitales
- Diferentes hipótesis de eficiencia de los mercados
- Consecuencias de la eficiencia del mercado y anomalías

#### Teoría de Carteras

- Aspectos fundamentales de la Teoría de Carteras
- Selección de la cartera óptima
- Modelo de mercado de Sharpe
- Modelo de equilibrio de los activos (CAPM)
- Otros modelos teóricos: Graham y Dodd

#### Proceso de Asignación de activos

- Definición
- Distribución de activos: Matriz de Asset Allocation
- Diferentes tipos de Asignación de Activos

#### Medición y Atribución de resultados

- Medidas de Rentabilidad
- Medidas de rentabilidad ajustadas al riesgo
- Comparación con un índice de referencia: Benchmark
- Aplicación al análisis y selección de fondos

#### Información del rendimiento a los clientes

- Atribución de resultados a corto y largo plazo

