

GESTION DE CARTERAS

28
HORAS

DESCRIPCIÓN

Introducir a los inversores en el conocimiento necesario para la toma de decisiones de inversión, para la correcta distribución de su patrimonio y para intervenir en los mercados financieros con unas garantías de éxito-seguridad, así como el entendimiento de los fenómenos que mueven los activos en los que depositamos nuestro patrimonio. El último fin es el de facilitar a los inversores una base para poder tomar sus propias decisiones, para poder entender que factores afectan a sus inversiones y para intentar anticipar las reacciones de los mercados.

OBJETIVOS

Introducir a los inversores en el conocimiento necesario para la toma de decisiones de inversión, para la correcta distribución de su patrimonio y para intervenir en los mercados financieros con unas garantías de éxito-seguridad, así como el entendimiento de los fenómenos que mueven los activos en los que depositamos nuestro patrimonio. El último fin es el de facilitar a los inversores una base para poder tomar sus propias decisiones, para poder entender que factores afectan a sus inversiones y para intentar anticipar las reacciones de los mercados.

CONTENIDOS

UNIDAD 1: Información del Rendimiento a los Clientes - Comunicación de resultados al cliente a corto y largo plazo - Normas internacionales de presentación de resultados. GIPS - Test final EFA_M3_Gestion_Carteras

UNIDAD 2: Medición y Atribución de Resultados - La rentabilidad como evaluación de resultados - La rentabilidad ajustada al riesgo - Comparación con un índice de referencia. Benchmark

UNIDAD 3: Proceso de Asignación de Activos - Asignación de activos - Proceso de asignación de activos - Asignación táctica y estratégica - Práctica y Seguimiento de la asignación - Resumen

UNIDAD 4: Gestión de Carteras - Selección de carteras óptimas - Cartera óptima con dos activos con riesgo - Modelo de Markowitz - Cartera óptima con un activo sin riesgo y un activo con riesgo - Modelo de mercado de Sharpe - Concepto de beta y beta de un activo - Beta de una cartera - Riesgo sistemático y riesgo específico - Riesgo de un activo - CAPM (Capital Asset Pricing Model) - Supuestos del Modelo - Del Modelo de Sharpe a la Fórmula del CAPM - Los mercados en equilibrio - Líneas CML y SML