



# Gestión de Carteras

 Duración: 28.00 horas

## Descripción

---

Este curso permitirá a los participantes adquirir un grado de conocimiento sobre cómo se componen las carteras de Renta Variable y Renta Fija, las técnicas de gestión de carteras más avanzadas, y cómo se cubre el riesgo de una cartera.

## 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

---

### Gestión de Carteras

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 del Rentabilidad

Medidas de rentabilidad ajustadas al riesgo

Comparación con un índice de referencia: Benchmark

Aplicación al análisis y selección de fondos

Atribución de resultados: Proceso y cálculos

Información del rendimiento a los clientes

Atribución de resultados a corto y largo plazo

Normas internacionales de presentación de resultados

Test Final

Documentación