

EVALUACIÓN DE PORTAFOLIOS DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS BURSÁTILES A TRAVÉS DE MODELOS FINANCIEROS COMPUTACIONALES.

MÓDULO 1: Diseñando una cartera de inversión óptima a partir de la teoría de selección de portafolios.

- 1.1 Concepto de teoría de portafolios. El Modelo de Markowitz y su aportación al acervo financiero.
- 1.2 El principio de diversificación de inversiones. Un enfoque al mercado bursátil mexicano.
- 1.3 ¿Qué es un modelo computacional y su aplicación a las inversiones financieras?

MÓDULO 2: Construyendo un portafolio de inversión. Modelo computacional para estimar la combinación idónea de Riesgo y Rendimiento de un inversionista.

- 2.1 Ejemplo de un portafolio óptimo con dos acciones.
- 2.2 Efecto de la correlación de activos
- 2.3 Matriz de rendimiento y matriz de riesgo.
- 2.4 Evaluación del riesgo versus rendimiento de una cartera. La Frontera Eficiente.
- 2.5 Identificación del perfil de riesgo financiero de un inversionista.

EVALUACIÓN DE PORTAFOLIOS DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS BURSÁTILES A TRAVÉS DE MODELOS FINANCIEROS COMPUTACIONALES.

MÓDULO 3: Laboratorio de Finanzas. Uso creativo de la hoja de cálculo electrónica Excel en la construcción de modelos financieros.

3.1 Uso de bases de datos de cotizaciones de instrumentos accionarios y guía para obtener la información.

3.2 Construcción de una cartera de inversión con la hoja de cálculo Excel.

3.3 Portafolio de mínimo riesgo. Función objetivo y restricciones del modelo. ¿Cuánto riesgo está dispuesto a correr?

3.4 Portafolio de máximo rendimiento. Función objetivo y restricciones del modelo. ¿Qué rendimiento desea obtener?

MÓDULO 4: Proyecto terminado: Modelo financiero de portafolios de inversión y recomendación al cliente inversionista.

4.1 Prospecto de inversión dirigido al cliente inversionista.

4.2 Comparativo con otras opciones de inversión disponibles en el mercado financiero mexicano. ¿Es mejor mi portafolio de inversión que otra alternativa del mercado?

4.3 Resumen Ejecutivo: Conclusiones del analista financiero para tres perfiles de inversionista: Conservador, Moderado y Agresivo.