



Curso Superior Excel aplicado a la Gestión de Carteras

En este Curso te mostramos el **fundamento teórico** y las **herramientas estadísticas** que se emplean en esta materia financiera, tomando datos de diferentes activos financieros que descargaremos de la plataforma **Bloomberg**, después mostramos los diferentes cálculos en hoja de cálculo de **Excel** para aprender replicar estos cálculos con los activos preferidos.

Aspectos destacables y objetivos

- ✓ Introducir el **marco teórico** de la gestión de carteras con un **enfoque eminentemente práctico**
- ✓ Introducir los **diferentes estadísticos** (coeficiente de correlación, desviación estándar, promedio aritmético, retorno continuo) que se emplean en la gestión de carteras
- ✓ Mostrar el formato que se genera cuando se descarga una serie temporal de cotizaciones con una plataforma de información financiera, en nuestro caso emplearemos **Bloomberg**
- ✓ Mostrar cómo se determina la rentabilidad y el riesgo de activos individuales y de una cartera de manera práctica con la **hoja de cálculo Excel**
- ✓ Mostrar mediante un ejemplo práctico y con datos reales la gran ventaja que supone **diversificar una cartera de activos con riesgo**
- ✓ Mostrar mediante la herramienta **Solver** (Excel) como podemos optimizar nuestra cartera seleccionando la ponderación de activos que resulta más eficiente según los datos históricos analizados
- ✓ Mostrar todos los **conceptos teóricos de manera práctica** con una herramienta universal como es la hoja de cálculo Excel
- ✓ **Crear una cartera** con diferentes clases de activos empleando para ello el **vehículo de inversión ETF**
- ✓ Aplicar a un ejemplo con datos reales la optimización **In-Sample versus Out-of-Sample**



Modalidad Online



Título de Curso Superior



275€

Claustro

Alexey De La Loma Jiménez
CFA, CMT, CAIA, FRM, EFA, CFTe

Programa

1. Midiendo la rentabilidad de activos individuales

- 1.1. Introducción a la gestión de carteras
- 1.2. Introducción a las series temporales
- 1.3. Rendimiento y medidas de rendimiento
- 1.4. Práctica con Excel

2. Midiendo el riesgo de activos individuales

- 2.1. Modelo Ex-ante versus modelo ex-post
- 2.2. Función de distribución de las rentabilidades
- 2.3. Tendencia central versus dispersión
- 2.4. Cálculo de la volatilidad
- 2.5. Práctica con Excel

3. Rentabilidad y riesgo de una cartera

- 3.1. Midiendo el grado de relación lineal entre dos variables
- 3.2. Rentabilidad y riesgo de la cartera
- 3.3. Coeficiente de correlación
- 3.4. Práctica con Excel

4. Modelo de Markowitz y Frontera Eficiente

- 4.1. Modelo de Markowitz y frontera eficiente
- 4.2. Riesgo sistemático y riesgo específico
- 4.3. Práctica con Excel

5. Modelo de valoración de activos financieros (CAPM)

- 5.1. Rentabilidad Libre de Riesgo (RFR)
- 5.2. Modelo de valoración de activos financieros (CAPM)
- 5.3. CML y SML
- 5.4. Práctica con Excel

6. Modelo de mercado y modelos de factores o índices

7. Medidas de Performance: Optimización de cartera con Solver

- 7.1. Medidas sobre el Comportamiento de la Cartera
- 7.2. Medidas de Performance
- 7.3. Práctica con Excel

8. Índices bursátiles y atribución de resultados

- 8.1. Índices Bursátiles
- 8.2. Atribución de resultados
- 8.3. Práctica con Excel






9. Diversificación de carteras (sectores y clases de activos)

- 9.1. Descomposición de Rentabilidad y Riesgo de la Cartera
- 9.2. Diversificación por sectores
- 9.3. Diversificación por categorías de activos
- 9.4. Práctica con Excel

10. Riesgos, Procedimientos y Participantes de la Gestión de Carteras

- 10.1. Gestión de carteras: diversificación y reducción del riesgo
- 10.2. Relación rentabilidad-riesgo, protección frente a riesgo bajista, MPT
- 10.3. Etapas del proceso de gestión de carteras
- 10.4. Tipología de Inversores
- 10.5. La Industria de la Gestión de Activos
- 10.6. Inversión colectiva: Fondos de Inversión
- 10.7. Inversión colectiva: Tipología de fondos de inversión
- 10.8. Inversión colectiva: Otros vehículos de inversión

A quién va dirigido

-  **Estudiantes y recién graduados** en economía, finanzas, administración de empresas o disciplinas afines
-  **Inversores individuales** que desean adquirir un conocimiento profundo y práctico sobre la gestión de carteras
-  **Profesionales del sector financiero** tales como asesores financieros, gestores de fondos, analistas y operadores de mercado que buscan actualizar y ampliar sus habilidades estadísticas
-  **Entusiastas del mercado financiero** que quieren aprender a utilizar datos reales y herramientas prácticas como Excel y Bloomberg
-  **Emprendedores y propietarios de empresas** que buscan mejorar su gestión financiera