

Administración cuantitativa de portafolios

Código: 14610024

Créditos: 2

El principal objetivo de este curso es proveer al estudiante las metodologías cuantitativas para la creación de estrategias de inversión desde la perspectiva de administradores de portafolios e inversionistas. En la primera parte del curso se hará una revisión de técnicas cuantitativas fundamentales para construir y evaluar portafolios. En la segunda parte del curso se hará especial énfasis en el análisis de la dinámica de diferentes clases de activos y presentar las estrategias de portafolios más comunes para cada tipo de activos, así como a la modelación de selección de portafolios globales. El problema de construcción de portafolios se presentará como un método cíclico en que se toman decisiones de diversificación ex-ante basadas en criterios de optimización y se crea un modelo en que se hacen los ajustes necesarios determinados por performance del portafolio expost. Las sesiones teóricas se combinarán con sesiones prácticas haciendo uso del paquete estadístico R con el que se pone a prueba las técnicas aprendidas sobre datos reales. Esto permitirá que los estudiantes desarrollen estrategias de gestión de portafolios teniendo en cuenta limitaciones y consideraciones del mundo real.

Contenidos: Teoría de portafolios y gestión de activos. Herramientas estadísticas y de optimización. Costos, medidas de performance y atribución. Backtesting, proporción de portafolios y rebalanceo. Estrategias de portafolios, selección y aseguramiento de portafolios. Acciones. Renta fija. Divisas. Crédito. Activos cruzados.