



Dates
2, 4, 5, 9, 11, 16, 18, 23, 25 i 26 de febrer

Horari
De 17:30 a 21:30 hores

Durada
40 hores

Lloc
Aules de l'IEF
Gran Via, 670
08010 Barcelona

Informació i inscripcions

Institut d'Estudis Financers
Gran Via, 670, 2n
08010 Barcelona
Tel: 93.412.44.31
Fax: 93.412.10.15
E-mail: infoief@iefweb.org
Web: www.iefweb.org

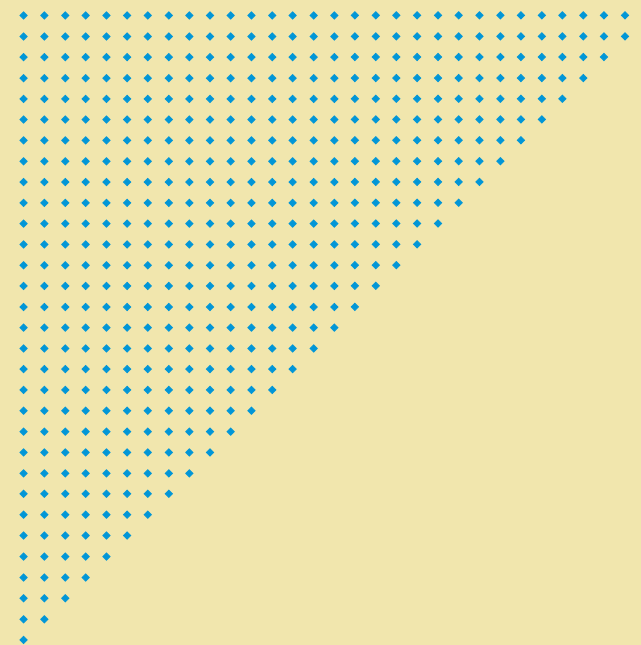


Col·laboració de:
IWBank 

Gestió de Carteres de Renda Variable

FA.21.02 Àrea de Finances Aplicades

Barcelona, del 2 al 26 de febrer del 2010



Gestió de Carteres de Renda Variable

Objectius

El curs proporciona als participants eines avançades per analitzar i gestionar carteres amb renda variable domèstica i internacional, amb una visió orientada cap a la gestió activa.

Durant el curs s'exposaran tècniques actuals de gestió i cobertura de carteres d'accions, i es posarà especial èmfasi en l'aplicació d'estratègies quantitatives; anàlisi, seguiment i mesura de la gestió activa i passiva, en estratègies de mesura i cobertura del risc, models per a definir quina és la cartera més adequada en cada moment del cycle econòmic i models de valoració específics per a empreses segons sigui la seva activitat (financeres, industrials, cíclicues...)

Participants

Professionals d'anàlisi, gestió i assessoria en bancs i caixes d'estalvis, gestores de fons d'inversió i de pensions, societats i agències de valors, companyies d'assegurances i altres entitats del sector financer. Directius i professionals d'empreses amb necessitat d'optimitzar la seva cartera d'inversió i professionals de consultores i assessories.

Coordinador

Ramon Alfonso Analista financer i Col·laborador acadèmic, IEF

Professorat

Ramon Alfonso Analista financer i Col·laborador acadèmic, IEF

Josep Codina Private trader i Col·laborador acadèmic, IEF

Pablo Larraga Director del Màster en Finances, IEF

Ramon Martínez Col·laborador acadèmic, IEF

Requisits

La inscripció al curs es regeix per les condicions internes d'admissió. L'abonament s'haurà de realitzar amb antelació. La no assistència es notificarà a l'IEF dos dies abans del començament del curs, com a mínim. En cas contrari s'haurà d'abonar el 100% de l'import.

La certificació de superació i aprofitament del curs pot estar condicionada a algun tipus de prova prèvia i, en tot cas, a l'assistència mínima a un 75% de les hores lectives.

Inscripció: 980 euros. Inclou assistència, documentació i *coffee-breaks*

Programa*

I. Eines Analítiques

I.1. Anàlisi fonamental. *Top Down*

- El cycle econòmic. Variables identificatives de cada fase del cycle
- Sectors que es comporten millor en cada fase del cycle econòmic
- Eines per a determinar la fase del cycle econòmic
- Generació d'una cartera de valors a partir d'un anàlisi *Top Down*. Exemple

I.2. Anàlisi fonamental de sectors i valors. *Bottom up*

- Elements per a la valoració d'una empresa
- Principals models de valoració d'empreses
- Model de valoració per a una empresa financera. Exemples
- Model de valoració per a una empresa industrial. Exemples
- Model de valoració per a una empresa elèctrica. Exemples
- Generació d'una cartera de valors a partir de l'anàlisi *Bottom Up*. Exemple

I.3. Anàlisi tècnica

- Principals models i eines d'anàlisi tècnica aplicada a la gestió de renda variable
- La gestió a llarg termini amb anàlisi tècnica. Exemples
- La gestió a curt termini amb anàlisi tècnica. Exemples
- Generació d'una cartera de valors a partir de l'anàlisi tècnica

2. Estratègies i Optimització de Carteres

2.1. Aplicació i ús de derivats en la gestió d'una cartera de renda variable

- Mercats i instruments per a la gestió de carteres. Exemples
- Cobertura del risc d'una cartera de renda variable. Exemples
- Arbitratges en la gestió de carteres de renda variable. Exemples

2.2. Optimització de carteres de renda variable

- Models quantitativs d'optimització de carteres: *Markowitz, Black-Litterman*. Exemples
- L'ús del VaR de mercat
- Ratis i mètriques per a mesurar la qualitat de la gestió en carteres de renda variable. Exemples

Dades personals

Nom i cognoms	
Data de naixement	
Adreça	
CP	Població
Telèfon	Mòbil
E-mail	
Nivell d'estudis (especificar)	

Dades professionals

Empresa	
Sector	
Càrrec	
Adreça	
CP	Població
Telèfon	Fax
E-mail	

Dades facturació

NIF/CIF	
Nom o raó social	
Adreça	
Contacte administratiu	

Les dades que ens faciliti amb aquesta butlleta, s'incorporen a un fitxer registrat en l'Agència Espanyola de Protecció de Dades que utilitzarem per trametre-li informació sobre les nostres activitats formatives i, si escau, per avaluar l'adequació del curs sol·licitat així com per comunicar-nos amb vostè sobre altres qüestions relacionades amb el mateix. El responsable del fitxer és la Fundació Privada Institut d'Estudis Financers [FPIEF], amb domicili a la Gran Via de les Corts Catalanes, núm. 670, 2n, de Barcelona (adreça electrònica: infoief@iefweb.org). En qualsevol moment pot adreçar-se a l'FPIEF per exercir, gratuïtament, el dret d'oposició, accés, rectificació o cancel·lació de les seves dades personals, així com per oposar-se a la recepció de correus electrònics o comunicats amb contingut publicitari.

Forma de pagament

- Taló nominatiu a Fundació Privada Institut d'Estudis Financers
- Transferència bancària al compte núm. 0182-6035-49-0201507074 (trameteu-nos la còpia del comprovant)

Signatura de l'assistent

* Inclou presentació pràctica de la plataforma informativa i de contractació de mercats d'IW Bank. Tots els alumnes rebran gratuïtament una llicència d'ús durant 2 mesos.