



Fechas
2, 4, 5, 9, 11, 16, 18, 23, 25 y 26 de febrero

Horario
De 17:30 a 21:30 horas

Duración
40 horas

Lugar
Aulas del IEF
Gran Vía, 670
08010 Barcelona

Información e inscripciones

Institut d'Estudis Financers

Gran Vía, 670, 2n
08010 Barcelona
Tel: 93.412.44.31
Fax: 93.412.10.15
E-mail: infoief@iefweb.org
Web: www.iefweb.org



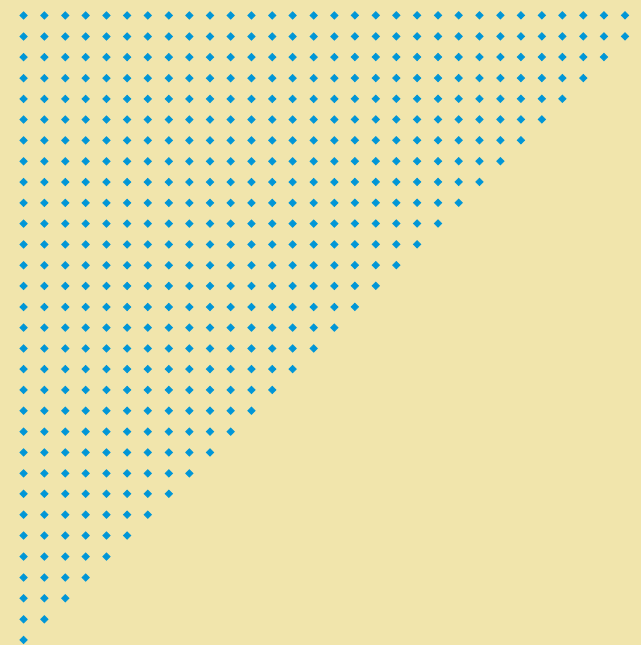
Colaboración de:



Gestión de Carteras de Renta Variable

FA.21.02 Área de Finanzas Aplicadas

Barcelona, del 2 al 26 de febrero de 2010



Gestión de Carteras de Renta Variable

Objetivos

El curso proporciona a los participantes herramientas avanzadas para analizar y gestionar carteras con renta variable doméstica e internacional, con una visión orientada hacia la gestión activa.

Durante el curso se expodrán técnicas actuales de gestión y cobertura de carteras de acciones, y se pondrá especial énfasi en la aplicación de estrategias cuantitativas; análisis, seguimiento y medida de la gestión activa y pasiva, en estrategias de medida y cobertura del riesgo, modelos para definir cual es la cartera más adecuada en cada momento del ciclo económico y modelos de valoración específicos para empresas.

Participantes

Profesionales del análisis, gestión y asesoría en bancos y cajas de pensiones, gestoras de fondos de inversión y de pensiones, sociedades y agencias de valores, compañías de seguros y otras entidades del sector financiero. Directivos y profesionales de empresas con necesidad de optimizar.

Coordinador

Ramon Alfonso Analista financiero y Colaborador académico, IEF

Profesorado

Ramon Alfonso Analista financiero y Colaborador académico, IEF

Josep Codina Private trader y Colaborador académico, IEF

Pablo Larraga Director del Máster en Finanzas, IEF

Ramon Martínez Colaborador académico, IEF

Requisitos

La inscripción al curso se rige por las condiciones internas de admisión. La devolución se deberá realizar con antelación. La no asistencia se notificará al IEF dos días antes del inicio del curso, como mínimo. En caso contrario se deberá abonar el 100% del importe.

La certificación de superación y provecho del curso puede estar condicionada a algún tipo de prueba previa y, en todo caso, a la asistencia mínima a un 75% de las horas lectivas.

Inscripción: 980 euros. Incluye asistencia, documentación y *coffee-breaks*.

Programa*

I. Herramientas Analíticas

1.1. Análisis fundamental. *Top Down*

- El ciclo económico. Variables identificativas de cada fase del ciclo
- Sectores que se comportan mejor en cada fase del ciclo económico
- Herramientas para determinar la fase del ciclo económico
- Generación de una cartera de valores a partir de un análisis *Top Down*. Ejemplo

1.2. Análisis fundamental de sectores y valores. *Bottom up*

- Elementos para la valoración de una empresa
- Principales modelos de valoración de empresas
- Modelo de valoración para una empresa financiera. Ejemplos
- Modelo de valoración para una empresa industrial. Ejemplos
- Modelo de valoración para una empresa eléctrica. Ejemplos
- Generación de una cartera de valores a partir del análisis *Bottom Up*. Ejemplos

1.3. Análisis técnico

- Principales modelos y herramientas de análisis técnico aplicado a la gestión de renta variable
- La gestión a largo plazo con análisis técnico. Ejemplos
- La gestión a corto plazo con análisis técnico. Ejemplos
- Generación de una cartera de valores a partir del análisis técnico

2. Estrategias y Optimización de Carteras

2.1. Aplicación y uso de derivados en la gestión de una cartera de renta variable

- Mercados e instrumentos para la gestión de carteras. Ejemplos
- Cobertura del riesgo de una cartera de renta variable. Ejemplos
- Arbitrajes en la gestión de carteras de renta variable. Ejemplos

2.2. Optimización de carteras de renta variable

- Modelos cuantitativos de optimización de carteras: *Markowitz, Black-Litterman*. Ejemplos
- El uso del VaR de mercado
- Ratios y métricos para medir la cualidad de la gestión en carteras de renta variable. Ejemplos

* Incluye presentación práctica de la plataforma informativa y de contratación de mercados de IW Bank. Todos los alumnos recibirán gratuitamente una licencia de uso durante 2 meses.

Datos personales

Nombre y apellidos

Fecha de Nacimiento

Dirección

CP

Población

Teléfono

Móvil

E-mail

Nivel de estudios (especificar)

Datos profesionales

Empresa

Sector

Cargo

Dirección

CP

Población

Teléfono

Fax

E-mail

Datos de facturación

NIF/CIF

Nombre o razón social

Dirección

Contacto administrativo

Los datos facilitados se incorporarán a un fichero registrado en la Agencia Española de Protección de Datos que utilizaremos para hacerle llegar información sobre nuestras actividades formativas y, en su caso, evaluar la adecuación del curso solicitado así como comunicarnos con usted sobre cuestiones relacionadas con el mismo. El responsable del fichero es la Fundació Privada Institut d'Estudis Financers [FPIEF] con domicilio en la Gran Via de les Corts Catalanes, 670, 2º, de Barcelona (correo electrónico: infoief@iefweb.org). Usted puede en cualquier momento dirigirse a la FPIEF para, gratuitamente, ejercer el derecho de oposición, acceso, rectificación o cancelación de sus datos personales así como oponerse a la recepción de correos electrónicos o comunicados con contenido publicitario.

Forma de pago

Talón nominativo a Fundació Privada Institut d'Estudis Financers

Transferencia bancaria a la cuenta nº 0182-6035-4902.0150.7074 (enviarnos la copia del comprobante)

Firma del asistente