

FINANZAS CUANTITATIVAS APLICADAS A LAS INVERSIONES

Dr. David Wahl, CFA

Taller dirigido a profesionales del sector finanzas, particularmente AFP, fondos mutuos y SABs, y estudiantes de economía, finanzas, FRM 2 y CQF.

Después de una revisión de los modelos básicos de generación de alfa, se presentan extensiones prácticas para la aplicación efectiva de modelos a la gestión de activos.

Temas

Generación de alfa vía la APT y Fama French. Fuentes de data. Implementación del modelo Fama-French en R. Encogimiento de Bayes-Stein. Nuevos factores: calidad, baja volatilidad, momentum. Reducción de rotación de activos. Backtesting. Algunos modelos dinámicos.

David Wahl

Luego de una breve carrera en física de altas energías pasó a trabajar en uno de los más grandes hedge-funds de Londres (Orbis Asset Management, 32 mil millones USD AUM) encargado de desarrollar modelos cuantita-

tivos para inversiones en acciones globales. Miembro activo del London Quant Group.

Lugar

IMCA, Los Biólogos 245, La Molina
Sábado 27 de Mayo, 9:00-14:00

Inscripciones

Depósitos en Banco Continental, cuenta CEAMAT-IMCA proyecto ICAC, No: 0011-148-0100019774-47
Profesionales S/ 400, estudiantes S/ 270, certificados aparte.

Más información en bit.ly/2qIVUkv

Encuentra este evento en [Eventbrite](#)