

FINANZAS CUANTITATIVAS APLICADAS A LAS INVERSIONES

Docente: Dr. David Wahl, CFA

Horario: Sábado 27 de mayo. 9:00-14:00

Lugar: Auditorio IMCA, Calle Los Biólogos 245, La Molina, Lima

email: info@peruvianquantgroup.org

Objetivo: Después de una revisión de los modelos básicos de generación de alfa, se presentarán extensiones prácticas para la aplicación efectiva de modelos en la gestión de activos.

Metodología: Sesiones teóricas complementadas con ejemplos de aplicaciones al mundo real

Dirigido a: Profesionales del sector finanzas, particularmente de AFP, fondos mutuos y SABs quienes podrían aplicar el material en su desempeño profesional diario. Estudiantes de ciencias exactas, economía y finanzas. Adicionalmente, notar que los temas abordados son parte del syllabus del certificado FRM 2 (libro 4) y del CQF (módulo 2).

Pre-requisitos: Conocimiento básico de finanzas (identificación de variables contables, entendimiento básico del mercado de acciones) y estadística (regresión lineal). Deseable conocimiento de R y de series de tiempo. No es necesario un conocimiento avanzado de matemáticas, cálculo en varias variables es suficiente.

Certificado: Al final del curso se otorgarán certificados a nombre del IMCA y Peruvian Quant Group.

Contenido:

- Modelando y venciendo al mercado: Introducción a la generación cuantitativa del alfa vía la Teoría del Arbitraje (APT) y el Modelo Fama French.
- El modelamiento en la práctica: Fuentes de data, dificultades prácticas y una simple implementación del modelo Fama-French en R.
- Mejorando los modelos estándar: Encogimiento de Bayes-Stein, nuevos factores (calidad, baja volatilidad, momentum), reducción de rotación de activos.
- Modelamiento Avanzado: Backtesting exitoso, el bello mundo de los modelos dinámicos.

Expositor: PhD. David Wahl, CFA

Después de una breve carrera en física de altas energías, David entro a trabajar en uno de los más grandes hedge-funds de Londres (Orbis Asset Management, 32 mil millones USD AUD) con la responsabilidad de desarrollar modelos cuantitativos para inversiones en acciones globales, tiempo durante el cual ha tenido la oportunidad de estudiar y trabajar con modelos usados por todo tipo de inversores, y por algunos de los más destacados fondos cuantitativos de inversión. Como miembro activo del London Quant Group, ha podido aprender sobre modelamiento financiero con algunos de los más reconocidos académicos del área. Uno de los objetivos del curso será compartir algunas ideas clave de esta experiencia.

The logo for Peruvian Quant Group features a vertical line on the left side. To the right of the line, the word "Peruvian" is written in a grey, sans-serif font. Below "Peruvian", the words "Quant Group" are written in a larger, bold, dark red serif font.

Peruvian
Quant Group

Precio y sistema de descuentos:

	Sólo curso	Certificado por separado	Paquete completo (certificado + curso)
Profesionales	400	100	450
Estudiantes (tiempo completo)	270	80	300

El precio es en Soles (S./)

Grupos de 3 o más personas (un solo depósito): descuento de 20%.

El día del evento traer DNI y el voucher del depósito original, o impreso en caso de transferencia online, estudiantes carnet universitario vigente.

Capacidad limitada.

A los profesionales se les dará adicionales beneficios de pertenecer a la red de networking de finanzas cuantitativas más grande del Perú e invitaciones a eventos exclusivos en temas más avanzados.

De darse algún evento fortuito no imputable a Peruvian Quant Group, se entregará una constancia por el importe del curso para aplicarlo en algún evento posterior.

Opciones de pago:

Transferencia y/o depósito bancario

Cuenta : Banco Continental

Titular de cuenta : CEAMAT-IMCA PROYECTO ICAC

Cuenta corriente en Soles : 0011-148-0100019774-47

Código de Cuenta Interbancaria : 011-148-000100019774-47

Informes e inscripción:

<http://peruvianquantgroup.org/>

info@peruvianquantgroup.org