Administración de riesgos financieros

Administración de riesgos financieros

Autor
Fernando Rodríguez Aranday

Sinopsis



E-Book

Año de publicación: 20220118

Presentación: EPUB (Digital: descarga y online)

Número de páginas orientativo de un producto digital: 200 Páginas

ISBN13: 9786075631554

2026 © Sistema Integrado de Metadata Estandarizada desarrollado por Hipertexto - Netizen

Este libro presenta la teoría, técnica, modelos y métodos empleados para medir el riesgo y administrarlo a fin de evitar caer en contingencias innecesarias que provoquen pérdidas que pongan en peligro la estabilidad de las empresas. El análisis de la información numérica y la de documentos oficiales permite evaluar, con una adecuada anticipación, el grado de riesgo en que pueden incurrir si no corrigen el rumbo de sus decisiones y saber cuándo se debe intervenir para aprovechar los eventos que les permitan obtener ventajas que se traduzcan en rendimientos para estas organizaciones. Los modelos estudiados (coeficiente de variación de Pearson, probabilísticos, riesgo sistemático y no sistemático, entre otros) se abordan con profundidad seria y profesional, lo cual permite aplicarlos en cualquier empresa. Asimismo, se menciona la importancia de evaluar de manera permanente los riesgos de operación. El autor explica, entre otros tópicos, la estructura óptima del capital, que permite identificar el porcentaje de deuda que incremente el valor de la empresa y el valor de la acción; la política de dividendos, esencial para aumentar el valor de las acciones sin poner en riesgo la liquidez de las empresas; las estrategias simples y complejas conformadas por una variedad de opciones financieras que posibilitan el aprovechamiento de las alzas y bajas del mercado para obtener buenos rendimientos de capital; la Teoría de Arbitraje de Precios, la cual plantea que en los mercados financieros pueden encontrarse dos instrumentos y/o subyacentes (divisas) iguales, uno cuyo precio en un mercado es barato y otro en un mercado donde es más caro, por lo que se recomienda comprar a bajo costo y vender a alto precio, respectivamente; la Teoría de Cartera, que sostiene la necesidad de buscar aquellas carteras que produzcan el mayor rendimiento para un riesgo dado, o bien el menor riesgo para un determinado rendimiento; el Valor en Riesgo, que es la medida más importante para administrar el riesgo y un modelo estadístico para valorar el riesgo en el activo; las griegas, con las cuales se identifican los riesgos de la compra o venta de opciones por movimientos en el precio, tiempo y tasa de interés de estas.

2026 © Sistema Integrado de Metadata Estandarizada desarrollado por Hipertexto - Netizen

Además, propone actividades para reforzar lo aprendido y hacer más sólido el conocimiento con preguntas ex profeso para los lectores de esta obra.



Sobre el autor

Fernando Rodríguez Aranday

2026 © Sistema Integrado de Metadata Estandarizada desarrollado por Hipertexto - Netizen