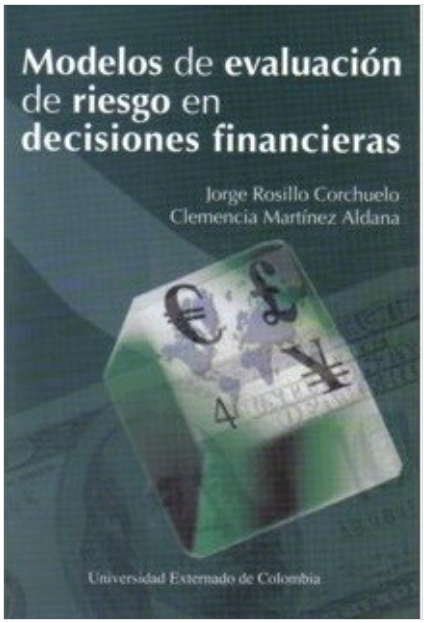
Modelos de evaluación de riesgo en decisiones financieras

Autor

Jorge Rosillo Corchuelo

Sinopsis

Es importante conocer algunos de los métodos para medir el riesgo de los portafolios y las carteras, a partir tanto de la recuperación de las inversiones y los impactos de las fluctuaciones de indicadores macroeconómicos como de las tasas de interés del mercado y las tasas de cambio.Igualmente es relevante medir la rentabilidad en función del riesgo que se genera por factores endógenos y exógenos al inversionista y que son cuantificables, bien sea que apartan del emisor o garante, en el caso de títulos valores, o de la formulación de flujos de inversión y de operación, en el caso de flujos de caja.Una vez medido el riesgo y determinada la rentabilidad aplicando instrumentos estadísticos, econométricos financieros, se está en capacidad de determinar el punto óptimo que se refleja en el concepto de la curva eficiente.Todo lo anterior se consigna en el presente libro, donde se desarrollan casos formulados en lenguaje computacional que ilustran los procesos de cálculo y facilitan la toma de decisiones para cualquier agente que administre portafolios de terceros o espere maximizar sus propias inversiones.Igualmente es relevante medir la rentabilidad en función del riesgo que se genera por factores endógenos y exógenos al inversionista y que son cuantificables, bien sea que apartan del emisor o garante, en el caso de títulos valores, o de la formulación de flujos de inversión y de operación, en el caso de flujos de caja.



Escanea para ver en línea

Impreso

Año de publicación: 2004

Presentación: Tapa blanda o Bolsillo

Tamaño: 14 x 21 cm

Número absoluto de páginas: 380 Páginas

ISBN13: 9789586168779

$63.000 COP

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

Una vez medido el riesgo y determinada la rentabilidad aplicando instrumentos estadísticos, econométricos financieros, se está en capacidad de determinar el punto óptimo que se refleja en el concepto de la curva eficiente.Todo lo anterior se consigna en el presente libro, donde se desarrollan casos formulados en lenguaje computacional que ilustran los procesos de cálculo y facilitan la toma de decisiones para cualquier agente que administre portafolios de terceros o espere maximizar sus propias inversiones.Una vez medido el riesgo y determinada la rentabilidad aplicando instrumentos estadísticos, econométricos financieros, se está en capacidad de determinar el punto óptimo que se refleja en el concepto de la curva eficiente.Todo lo anterior se consigna en el presente libro, donde se desarrollan casos formulados en lenguaje computacional que ilustran los procesos de cálculo y facilitan la toma de decisiones para cualquier agente que administre portafolios de terceros o espere maximizar sus propias inversiones.Todo lo anterior se consigna en el presente libro, donde se desarrollan casos formulados en lenguaje computacional que ilustran los procesos de cálculo y facilitan la toma de decisiones para cualquier agente que administre portafolios de terceros o espere maximizar sus propias inversiones.

JR

Sobre el autor

Jorge Rosillo Corchuelo

E-Book

Año de publicación: 2004

Presentación: PDF (Digital: descarga y online)

ISBN13: 9789586168779

$38.000 COP

Palabras clave

Evaluación de riesgo; Decisiones financieras; Portafolios; Inversiones; Impactos; Fluctuaciones; Indicadores

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