



CENTRUM
PUCP

Executive
Education
SAN ISIDRO

CURSO EDEX

Asset Management



Descripción

El Asset Management aplica la teoría financiera y problemas de la gestión de activos. Para comprender estos problemas, debemos comenzar con los objetivos, las características y las consideraciones específicas del propietario del activo. Los propietarios de activos pueden ser individuos, propietarios colectivos, donaciones y fundaciones de caridad, corporaciones y naciones.

El objetivo principal de este curso es conocer y estudiar la industria de asset management, su funcionamiento en relación a los mercados financieros, los vehículos de inversión más importantes, su racionalidad enfatizando aspectos fundamentales de gestión de portafolios así como aspectos prácticos en el campo de la estructuración de carteras.

Dirigido a

Profesionales del área de finanzas que quieran conocer el manejo de los mercados financieros.

Objetivo de aprendizaje

El propósito del curso es proporcionar a los estudiantes el conocimiento suficiente para que puedan desarrollar sus actividades en un contexto de incertidumbre propio de un mercado globalizado.

Contenido

SESIONES	DÍA	MES	TEMA
1 y 2	Viernes 09	Octubre	Asset Management y los Mercados Financieros <ul style="list-style-type: none">• Rol e Importancia del Asset Management• Mercados Financieros.• Tipos de Activos.• Intermediarios Financieros.• La Ingeniería Financiera.• Rol de la Banca de Inversión.
3 y 4	Viernes 16	Octubre	Mercados Financieros <ul style="list-style-type: none">• Oferta Pública y Privada de Valores.• Negociación.
5 y 6	Viernes 23	Octubre	El Proceso de Asset Management <ul style="list-style-type: none">• La Gestión del Riesgo.• Administradores de Fondos.• Fondos Mutuos, Fondos de Inversión y Otros.• El Proceso de Inversión.
7 y 8	Viernes 30	Octubre	Expectativas de Mercados de Capitales <ul style="list-style-type: none">• Rentabilidad y Riesgo de Activos.• Riesgo y Retorno Esperado de una Cartera.• Aversión al Riesgo.• La Diversificación.

CENTRUM PUCP podrá efectuar cambios en la malla, secuencia de los cursos o profesores, de acuerdo a su política de mejora continua. Cualquier eventual cambio en la programación les será comunicado oportunamente.

 **Contenido**

SESIONES	DÍA	MES	TEMA
9 y 10	Viernes 06	Noviembre	La Asignación de Activos en un Portafolio <ul style="list-style-type: none">• El Activo Libre de Riesgo.• Portafolio Riesgoso Óptimo.• Línea de Mercado de Capitales.• Teorema del Fondo de Inversión.• Implicancias en la Gestión de Inversiones.
11 y 12	Viernes 13	Noviembre	Relación Riesgo-Retorno <ul style="list-style-type: none">• El Modelo CAPM.• La Prima por Riesgo de Mercado.• El Beta.• Rentabilidad Esperada de un Activo.• Línea de Mercado de Valores.
13 y 14	Viernes 20	Noviembre	Relación Riesgo-Retorno <ul style="list-style-type: none">• Rentabilidad Esperada y Realizada.• El Modelo de Índice.• El Modelo APT.• La Estrategia de Arbitraje.
15 y 16	Viernes 27	Noviembre	Eficiencia de Mercado <ul style="list-style-type: none">• Caminata Aleatoria.• Hipótesis de Mercado Eficiente.• Implicancias en la Gestión de Inversiones.• Rol de la Gestión de Carteras.

CENTRUM PUCP podrá efectuar cambios en la malla, secuencia de los cursos o profesores, de acuerdo a su política de mejora continua. Cualquier eventual cambio en la programación les será comunicado oportunamente.





 **Juan Pablo Noziglia**

El profesor Noziglia es Economista con amplia experiencia en la gestión de estrategias de cartera de activos múltiples. Actualmente CIO para uno de los mayores fondos de pensiones privadas peruanas con más de US \$ 12 mil millones en AUM. Lideró diferentes equipos en una serie de acuerdos de emisión de deuda del mercado primario en el espectro corporativo y de financiamiento de proyectos. Actualmente es docente en CENTRUM PUCP Business School.

 **Inicio**
09 de Octubre

 **Frecuencia**
Semanal
Todos los Viernes
19:00 - 22:30

 **Modalidad**
Remota
(Clases en tiempo real)

 **Horario**
Sesión 1:
19:00 - 20:30
Break:
20:30 - 21:00
Sesión 2:
21:00 - 22:30