

FUNDACIÓN UNIVERSITARIA LUIS AMIGÓ
Portafolio de Renta Variable
Especialización en Finanzas

Parámetros para el Análisis Fundamental del Portafolio de R.V Internacional.

1. GON.
2. Análisis gráfico.
3. Filtro estados financieros.
4. Precio actual de acción.
5. Precio máximo en las últimas 52 semanas.
6. Precio mínimo en las últimas 52 semanas.
7. Volumen promedio de transacciones diarias.
8. Capitalización en el mercado.
9. Utilidad neta por acción en los últimos 12 meses.
10. Dividendo por acción.
11. Dividendo por acción expresado como porcentaje del precio actual de la acción (Yield).
12. Para cada especie determine si el mercado está sobrecomprado ó sobrevendido.
13. Sector económico e industria donde opera la compañía.
14. Relación precio / utilidad neta por acción.
15. Condición general de la economía. (Análisis Subprime).
16. Psicología del mercado bursátil y si ésta tiene tendencia al alza o a la baja y por qué.
17. Percepción de riesgo internacional.
18. Cuál de las especies admite mayor control hacia la diversificación. Por qué.
19. Composición del portafolio óptimo: rentabilidad esperada, volatilidad y si el fondo para invertir fuera de 80 millones cuánto invertiría en cada título.
20. Con base en la frontera eficiente se obtuvo una fuerte, leve o nula diversificación del riesgo del portafolio. Por qué.
21. Rendimiento exigido por el mercado para cada acción en términos anuales y ¿qué decisión tomaría ud frente a este indicador?
22. Hallar la probabilidad de que el portafolio registre un rendimiento anual inferior del 10.5% asociado al portafolio base.
23. Con base en los diferentes niveles de riesgo diario asumido por el inversionista y el valor esperado del portafolio con incrementos de 0.1% hasta 1%; determine por medio de un análisis de sensibilidad múltiple el impacto sobre la probabilidad de ocurrencia de cada escenario.
24. Prima de riesgo. Se está en presencia de mercados normales o invertidos. Por qué.
25. Beta apalancado y desapalancado.
26. Para un nivel de confianza del 95% determine la pérdida máxima diaria individual y de cartera.
27. Encuentre el modelo de pronóstico para cada emisor y determine su relevancia estadística.
28. Cuál empresa a mostrado mayor flujo de caja libre y cuál mayor Ebitda.



29. Organice a los emisores según el ROA y ROE.
30. Presente de manera ordenada un cuadro resumen de las principales variables fundamentales que han soportado sus decisiones para contrastar el portafolio óptimo de Markowitz.
31. no escamite su creatividad para inferir sobre las diferentes matrices calculadas.

Nota.

- Para los rendimientos libre de riesgo trabaje con la tasa 3.85% de los bonos del tesoro americano a 10 años.
- El beta calculado por la regresión lineal esta apalancado.
- Trabaje con tasa fiscal promedio para EEUU 25%.
- Para determinar tendencias trabaje con PM20.