

UNIVERSIDAD AUTONOMA LATINOAMERICANA
ESPECIALIZACIÓN EN GERENCIA FINANCIERA
DEBER03

Parámetros para Estructurar y Gestionar R.V

Para implementar este deber, vamos a estructurar un portafolio de 4 activos de renta variable más el índice de mercado SP&500. Fecha de inicio: Enero 01 de 2005. Fecha final: Marzo 12 de 2010. Frecuencia de cotización: Semanal Tipo de precio: De cierre.

Parte A: Estructuración

Se recomienda ver el archivo modelo:

<http://www.gacetafinanciera.com/TEORIARIESGO/PORTAF.xls>

Parte B: Gestión

1. análisis gráfico.
2. filtro estados financieros.
3. precio actual de acción.
4. precio máximo en las últimas 52 semanas.
5. precio mínimo en las últimas 52 semanas.
6. volumen promedio de transacciones diarias.
7. capitalización en el mercado.
8. utilidad neta por acción en los últimos 12 meses.
9. dividendo por acción.
10. Determine el Yield de cada instrumento.
11. sector económico donde opera la compañía.
12. relación precio / utilidad neta por acción.
13. Con base en el RSI, recomendaría entrar largo o corto en cada acción.
14. cuál de las especies admite menor control hacia la diversificación. Por qué.
15. composición del portafolio óptimo: rentabilidad esperada, volatilidad y si el fondo para invertir fuera de 150 millones cuánto invertiría en cada título.
16. rendimiento exigido por el mercado para cada acción en términos anuales.
17. Determine el precio promedio futuro a junio 30 de 2010 al título menos riesgoso de su portafolio.
18. Encuentre el precio mínimo y máximo, para el activo del punto 18, pronosticado a junio 30 de 2010, dado un nivel de confianza del 95%.
19. Qué nivel de riesgo se asume hasta junio 30 de 2010 al invertir en la empresa más segura de la cartera analizada.
20. Según la Prima de Riesgo, el mercado es normal ó invertido. Argumente.
21. No escatime su creatividad para inferir sobre las diferentes matrices calculadas.