

FUNDACIÓN UNIVERSITARIA LUIS AMIGÓ
Especialización en Finanzas
Subyacente RVI

11/04/2015

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

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. Precio futuro a enero 31/2013
7. Volatilidad futura a enero 31/2012
8. Precio mínimo y máximo a enero 31/2012
9. Volumen promedio de transacciones diarias.
10. Capitalización en el mercado.
11. Utilidad neta por acción en los últimos 12 meses.
12. Dividendo por acción.
13. Dividendo por acción expresado como % del precio actual de la acción (Yield).
14. Sector económico donde opera la compañía.
15. Relación precio / utilidad neta por acción.
16. Intervalos de Chebichev.
17. Condición general de la economía.
18. Psicología del Mk bursátil y si ésta tiene tendencia al alza o a la baja y por qué.
- 19.Cuál de las especies admite mayor control hacia la diversificación. Por qué.
20. Si la rentabilidad del mercado se estima en 5%, determine el impacto sobre la rentabilidad de cada titulo de renta variable.
21. Composición del portafolio óptimo: rentabilidad esperada, volatilidad y si el fondo para invertir fuera de USD50 millones cuánto invertiría en cada titulo.
22. Con base en la frontera eficiente se obtuvo una fuerte, leve o nula diversificación del riesgo del portafolio. Por qué.
23. Rendimiento exigido por el mercado para cada acción en términos anuales.
24. Hallar la probabilidad de que el portafolio registre un rendimiento anual inferior del 12% asociado al portafolio base.
25. 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.
26. Prima de riesgo. Se está en presencia de mercados normales o invertidos. Por qué.
27. De acuerdo al perfil del grupo, en cuales especies entraría Corto ó largo. Sustente.
28. beta apalancado y desapalancado.
29. No escatime su creatividad para inferir sobre las diferentes matrices calculadas.

Nota.

- Para los rendimientos libre de riesgo trabaje con la tasa 6.25%.
- El beta calculado por la regresión lineal esta apalancado.
- Trabaje con tasa fiscal promedio 25.5%.
- Para determinar tendencias trabaje con PM20.