

# PORTFOLIO STRATEGIES AND RISK MANAGEMENT FOR BUY SIDE

Polarization:  $I = I_0 \cos^2 \theta$   
 refraction:  $n_1 \sin \theta_1 = n_2 \sin \theta_2$   
 critical angle:  $\theta_c = \sin^{-1} \frac{n_2}{n_1}$   
 Brewster's angle:  $\theta_B = \tan^{-1} \frac{n_2}{n_1}$   
 Thin film:  $2L = (n+1) \frac{\lambda}{2}$  (maxima),  $2L = \frac{m\lambda}{2}$  (minima)  
 Double slit:  $\Delta L = d \sin \theta$ ,  $d \sin \theta = m\lambda$  (maxima),  $d \sin \theta = (m + \frac{1}{2})\lambda$  (minima)  
 Single slit:  $a \sin \theta = m\lambda$ ,  $I = I_m (\frac{\sin \alpha}{\alpha})^2$   
 Diffraction gratings:  $d \sin \theta = m\lambda$   
 Dispersion:  $D = \frac{m}{d \cos \theta}$   
 Spherical mirror:  $\frac{1}{p} + \frac{1}{i} = \frac{1}{f}$ ,  $M = -\frac{i}{p}$   
 Lens:  $\frac{1}{f} = (n-1) \left( \frac{1}{r_1} - \frac{1}{r_2} \right)$ ,  $M = m_1 \cdot m_2$   
 Ray diagrams for concave, convex, converging, and diverging lenses.

**JUNIO  
2019**

**CIUDAD  
DE MÉXICO**



**RiskMathics  
FINANCIAL INSTITUTE**



## CHRIS MARTIN

DIRECTOR  
AXIOMA

Chris Martin ha trabajado en Axioma por más de 11 años en varias posiciones que van desde Soporte, Administración de cuentas, Consultor y actualmente es Especialista de Producto. Internamente, trabaja de cerca con todos los miembros del equipo de Axioma, que incluyen: Producto, Investigación, Contenido, Ventas y Soporte.

Este rango de experiencia le permite a Chris satisfacer las necesidades de los clientes de Axioma, ya sea capacitando a nuevos usuarios o ayudando a los usuarios existentes a aprovechar al máximo las soluciones de Axioma.

Chris recibió su Maestría en Ingeniería Financiera, un título conjunto de la Escuela de Administración y Ciencias Matemáticas Drucker en Claremont Graduate University. Recibió su licenciatura en Ingeniería General con especialización en Ingeniería Aeronáutica y Mecánica y un Mención en Física de la Universidad Politécnica Estatal de California, San Luis Obispo.

### TEMARIO:

1. Risk Management.
    - Factor Models.
    - Simulation Based.
    - Stress Testing.
  2. Portfolio Construction.
    - Equity.
    - Fixed Income.
    - Multi-Asset Class.
  3. Performance Attribution.
    - Factor-based.
    - Returns-based.
-

**DURACIÓN: 7 Horas**

**SEDE:**

**Hotel JW Marriott Santa Fe**  
Avenida Santa Fe 160 Col. La Fe Santa Fe, CDMX.

**COSTO: \$15,000.00 M.N. + IVA**

## REQUERIMIENTOS

1. Contar con nivel medio o superior de inglés.
2. Ser egresado de carreras económico - administrativas.
3. De preferencia, trabajar en instituciones financieras.
4. Es necesario el uso de laptop.

## OPCIONES DE PAGO:

1. Residentes e Instituciones establecidas en México  
Transferencia y/o Depósito Bancario  
NOMBRE: RiskMathics, S.C.  
BANCO: BBVA Bancomer  
CLABE: 012180001105829640  
CUENTA: 0110582964
2. Residentes e instituciones establecidas en el extranjero  
Transferencia Bancaria en Dólares  
BANCO: BBVA Bancomer  
SUCURSAL: 0956  
SWIFT: BCMRMXMM  
BENEFICIARIO: RiskMathics, S.C.  
CUENTA: 0121 8000 11 0583 0066
3. Pago vía telefónica  
Tarjeta de crédito VISA, MASTERCARD o AMERICAN EXPRESS

NOTA IMPORTANTE: No existen reembolsos ni devoluciones



## REGISTRO E INSCRIPCIONES

E-mail: [derivatives@riskmathics.com](mailto:derivatives@riskmathics.com)

Teléfonos: +52 (55) 5638 0367  
y +52 (55) 5669 4729

SÍGUENOS EN  
RiskMathicsFI



**WWW.RISKMATHICS.COM**