

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: $\theta_B = \tan^{-1} \frac{n_2}{n_1}$

Double slit: $\Delta L = d \sin \theta$
 $d \sin \theta = m\lambda$ (maxima)
 $d \sin \theta = (m + \frac{1}{2})\lambda$ (minima)
 $I = 4I_0 \cos^2(\frac{\phi}{2})$
 $\phi = \frac{2\pi d}{\lambda} \sin \theta$
 Thin film: $2L = (m + \frac{1}{2})\lambda$ (maxima)
 $2L = m\lambda$ (minima)

Single slit: $a \sin \theta = m\lambda$
 $I = I_m (\frac{\sin \alpha}{\alpha})^2$

Diffraction gratings: $d \sin \theta = m\lambda$

Dispersion: $D = \frac{m}{d \cos \theta}$
 $R = Nm$ resolving power

Spherical mirror: $\frac{1}{p} + \frac{1}{i} = \frac{1}{f}$
 $f = \frac{\text{radius of curvature}}{2}$
 $m = \frac{h'}{h} = -\frac{i}{p}$
 pos $m =$ same orientation

Concave mirror: real, virtual
 Convex mirror: virtual, diverging

Lens: $\frac{1}{f} = (n-1)(\frac{1}{r_1} - \frac{1}{r_2})$
 $M = m_1 \cdot m_2$
 $m_\theta = \frac{25 \text{ cm}}{f}$

Ray diagrams for mirrors and lenses showing object (O), image (I), focal points (F), and centers of curvature (C).

JUNE
2019

MEXICO
CITY



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.

TOPICS:

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.
-

DURATION: 7 Hours

VENUE:

JW Marriott Santa Fe Hotel
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.

PAYMENT METHODS:

1. Bank Transfer in US Dollars (Foreign Institutions)

BANK: BBVA Bancomer

ACCOUNT NUMBER: 0121 8000 11 0583 0066

SWIFT: BCMRMXMM

BRANCH NUMBER: 0956

BENEFICIARY: RiskMathics, S.C.

2. Credit Card: VISA, MASTERCARD or AMERICAN EXPRESS.

IMPORTANT NOTICE: There will be no reimbursements.



REGISTRATION

E-mail: derivatives@riskmathics.com

Telephone: +52 (55) 5638 0367

+52 (55) 5669 4729

FOLLOW US
RiskMathicsFI



WWW.RISKMATHICS.COM