

Curso de Verano de Finanzas Avanzadas 2025

Aplicaciones de IA para la Gestión de Portafolios

Lima, Perú - 3 y 4 de marzo



Resumen Ejecutivo

1 Espacio para comentarios adicionales por parte de los profesores...



Aplicaciones de IA para la Gestión de Portafolios

¿Qué conocimientos y experiencia planeamos transmitir?

Contenido del curso* "Aplicaciones de IA para la Gestión de Portafolios"

Día 1 – Lunes 3 de marzo

Mañana

10:00 – 11:00 am



Demostración MAGIC: Agentes Financieros en Acción



Introducción a la plataforma MAGIC y su aplicación en la simulación de decisiones de inversión.

11:00 – 12:00 pm



Inteligencia de Decisión: Fundamentos



Principios básicos de inteligencia artificial aplicada a la toma de decisiones financieras.

12:00 – 2:00 pm



Break (Almuerzo)

Tarde

2:00 – 3:00 pm



Marco de Inversión: Fundamentos / Aprendizaje de Máquinas – Statistical Learning



Aplicación de modelos estadísticos en la identificación de patrones financieros.

3:00 – 4:00 pm



Aprendizaje de Máquinas – Supervisado



Técnicas supervisadas para la predicción y clasificación de datos financieros.

4:00 – 5:00 pm



Aprendizaje de Máquinas – No Supervisado



Métodos de clustering y reducción de dimensionalidad para análisis de datos.

*El contenido resaltado no se alcanzó a cubrir en su totalidad

Contenido* del curso "Aplicaciones de IA para la Gestión de Portafolios"

Día 2 – Martes 4 de marzo

Mañana

9:00 – 10:00 am

- 🤖 De Quants a Copilots: Dónde Estamos en IA
- 🚀 Evolución de la inteligencia artificial en la gestión de portafolios.

10:00 – 11:00 am

- 📚 Deep Learning
- 💡 Redes neuronales profundas y su aplicación en predicción y clasificación financiera.

11:00 – 12:00 pm

- 📘 LLMs (Large Language Models)
- 💻 Aplicación de modelos de lenguaje en la automatización y análisis de texto financiero.

12:00 – 2:00 pm

- ☕ Break (Almuerzo)

Tarde

2:00 – 4:00 pm

- 📝 Aplicaciones de IA en Gestión de Portafolios
- 🛠 Casos de uso prácticos y herramientas para la optimización de portafolios.

4:00 – 4:30 pm

- ⚖️ Seguridad y Ética en IA
- 🔴 Consideraciones éticas y riesgos asociados al uso de IA en finanzas.

4:30 – 5:00 pm

- 🧠 Reflexiones sobre el Futuro con IA
- 💡 Discusión sobre las perspectivas y tendencias futuras de la IA en la gestión de portafolios.

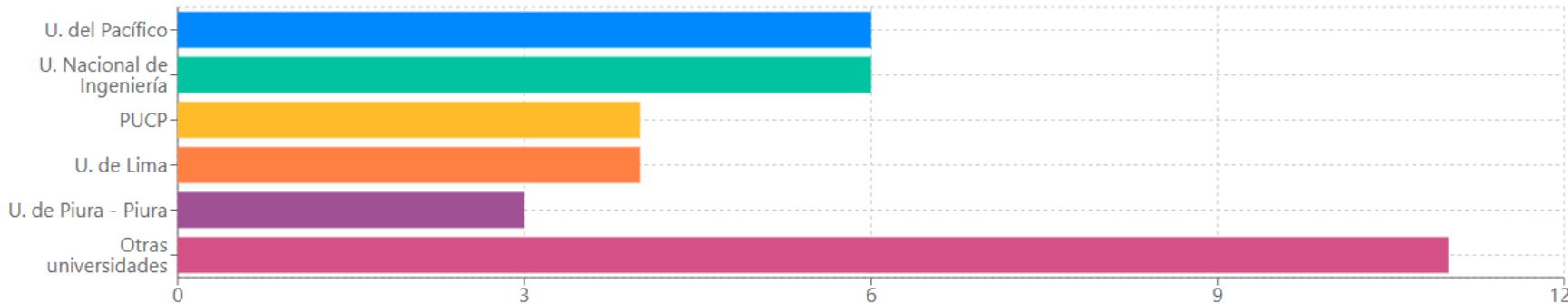
*El contenido resaltado no se alcanzó a cubrir en su totalidad

¿Cuál fue la audiencia?

Análisis Demográfico



Distribución por universidad



Hubo 34 estudiantes



Hombres: 25
Mujeres: 9

Distribución Geográfica

- **Lima:** 26 estudiantes
- **Piura:** 3 estudiantes
- **Internacional (UK):** 1 estudiante
- **Otros:** 4 estudiantes

• **Universidades Privadas:** 24 estudiantes

• **Universidades Nacionales/Públicas:** 9 estudiantes

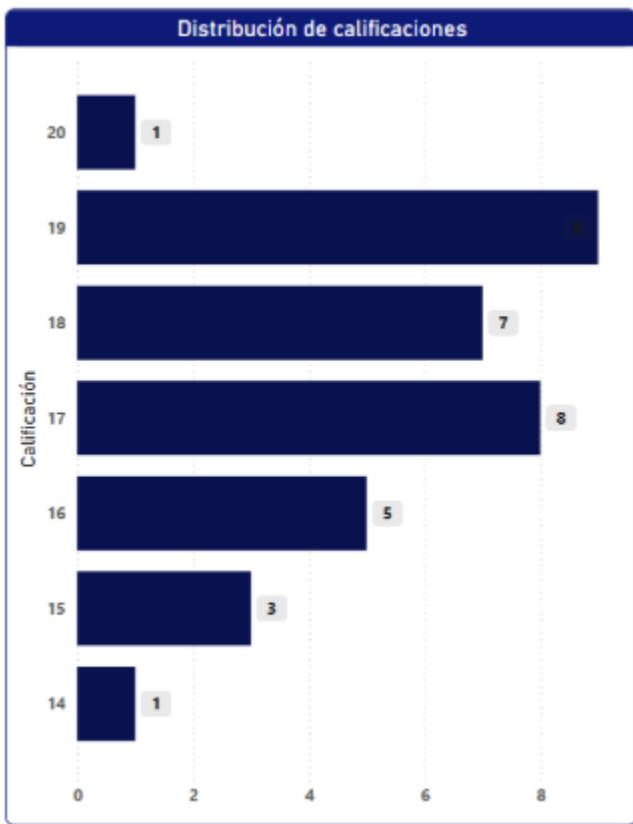
• **Universidad Internacional:** 1 estudiante

En esta cohorte se presento un estudiante internacional.

Resultados Examen Final



Se realizo un examen de selección múltiple compuesto por 10 preguntas conceptuales y 5 ejercicios prácticos donde los resultados fueron los siguientes:





¿Cómo evaluaron la experiencia los asistentes?

Resultados de encuesta anónima de satisfacción | 21 participantes respondieron

Hallazgos del curso:

1 Expectativas Cumplidas

- El curso logró satisfacer las expectativas de los estudiantes, reflejando un alto nivel de aceptación y relevancia en los temas tratados.

2 Valoración Positiva de los Profesores

- Los participantes expresaron satisfacción y entusiasmo con el desempeño de los profesores, destacando su conocimiento y experticia.

3 Momentos "Eureka"

- Varios estudiantes tuvieron instantes de comprensión profunda en distintos temas, lo que indica que el contenido fue impactante y de alto interés.

4 Apreciación por la Dinámica y Contenidos Vanguardistas

- La estructura interactiva del curso fue bien recibida, y los estudiantes desean mantener este enfoque dinámico con temas alineados a las últimas tendencias del sector.

5 Oportunidad de Extender el Tiempo de Presentación

- Se identificó la necesidad de ampliar la duración del curso para profundizar en:

- ◆ Práctica en Python 

- ◆ Modelos de Lenguaje (LLMs) 

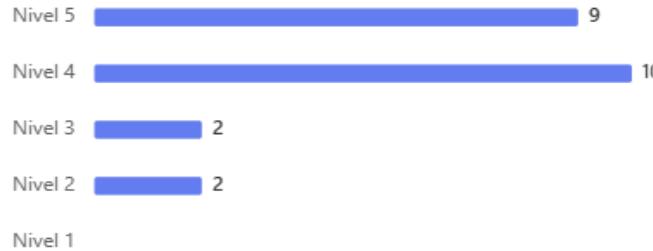
- ◆ Casos prácticos en gestión de portafolios 

En general, los resultados de la encuesta reflejan una experiencia enriquecedora y con oportunidades claras de optimización para futuras ediciones. 

En su mayoría los estudiantes consideraron que el curso cumplió sus expectativas y que el curso debería mantenerse en el tiempo

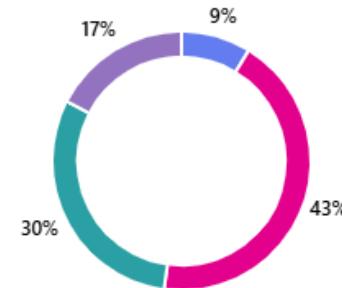
Si fueras el director del CEFA... ¿Qué tan probable es que mantengas este curso en el programa? (1 = Nada probable, 5 = Extremadamente probable) (0 punto)

4.13
Clasificación promedio

Expectativas vs. Realidad ¿El curso cumplió con lo que esperabas? (0 punto)

-  Superó mis expectativas 2
-  Cumplió completamente mis expectativas 10
-  Cumplió parcialmente mis expectativas 7
-  No cumplió mis expectativas 4
-  Estaba muy por debajo de mis expectativas 0



¿Qué destacaron del desempeño de Antonio como instructor?

“El profesor se deja explicar perfectamente utilizando ejemplos y motivando a los alumnos a participar. Se ve que le gusta enseñar y trasmite buenas energías, motivándonos a prestar atención a la clase.”

“Muy bueno, está dispuesto a responder cualquier tipo de consulta. Y tiene una noción del mundo tecnológico financiero actual, lo cual le permite actualizar a los alumnos con las nuevas tecnologías en el mundo financiero.”

“Su capacidad para suscitar interés y comunicar claramente todos los conceptos.”

“Es un buen instructor, buena exposición, y dominio de temas”



Sobre Antonio Candia, evalúa: Escala: (1 = Deficiente, 5 = Excelente) (0 punto)

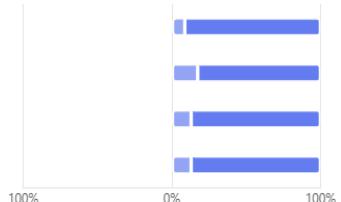
● 1 ● 2 ● 3 ● 4 ● 5

Dominio del tema

Claridad en la explicación

Capacidad para responder preguntas

Metodología de enseñanza



100%

0%

100%

Puntaje promedio

4.87

¿Qué destacaron del desempeño de Esteban como instructor?

“Buen desempeño, se nota que domina los temas y destaco su orden en el código y en los ppts de su contenido”

“Es muy inteligente, sabe de lo que habla”

“Tiene un buen dominio de los temas.”

“Centrado y va al punto”

“Siempre dispuesto a resolver dudas.”

“Se nota que tiene amplios conocimientos.”



Sobre Esteban Camargo, evalúa: Escala: (1 = Deficiente, 5 = Excelente) (0 punto)

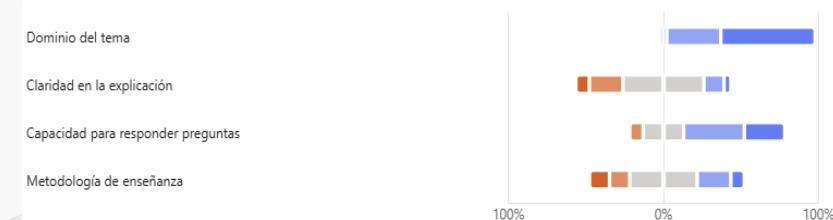
● 1 ● 2 ● 3 ● 4 ● 5

Dominio del tema

Claridad en la explicación

Capacidad para responder preguntas

Metodología de enseñanza



Puntaje promedio

3.74

Momento EUREKA: ¿Cuál fue ese instante en que sintieron un "¡Ajá!" durante el curso? (cuando algo realmente hizo clic en su mente y cambió su perspectiva)

"Lo de Hierarchical Risk Parity (HRP) y su aplicación en la gestión de portafolios. Me parece impresionante cómo este enfoque combina Machine Learning, clustering jerárquico y optimización de riesgo para construir portafolios más robustos sin necesidad de invertir la matriz de covarianza como en Markowitz."

"Me encantó cuando se explicó que el mundo está tendiendo a trabajar en equipos multidisciplinarios en fintech. Considero que es un impulso para cambiar las perspectivas de mercado laboral e inducirnos en aprender aspectos más allá de las finanzas clásicas."

"Cuando vimos la nueva herramienta de IA especializada"

"Cuando se habló de la evolución de la inteligencia artificial y cómo se está aplicando en finanzas. Me incentivó a querer seguir aprendiendo."



¿Qué aspectos del curso deberían mantenerse sin cambios?

"Se debería mantener estos tópicos que vienen originándose recientemente. La parte teórica fue excelente"

"Machine learning y deep learning y python"

"Algoritmos y métodos de optimización"

"La organización fue muy buena, se cumplían los horarios, y los temas abordados fueron relevantes"

"Los memes y que se compartan los materiales desde el día 1"



Oportunidades de mejora -¿Qué podría mejorarse?

"Resumir más el contenido y enseñar un poco más de Machine Learning, ya que vimos poco."

"Contenido más enfocado a la práctica, quizás no se hizo mucho énfasis en python, hubiese sido interesante verlo aplicado en algún caso del día a día"

"Más ejercicios prácticos. Y más tiempo para el curso. Fue muy corto."

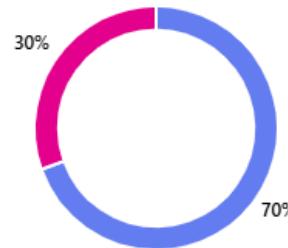
"Que haya más tiempo para procesar la información, que estaba muy interesante y tiene mucho potencial"

"Tener más tiempo! Son muchos conceptos para solo dos días"

¿Qué percepción tuvieron sobre la duración y ritmo de las clases?

La duración del curso te pareció: (0 punto)

- Insuficiente 16
- Adecuada 7
- Excesiva 0



El ritmo de las sesiones fue: (0 punto)

- Demasiado lento 1
- Adecuado 14
- Demasiado rápido 8

