



## GUÍA DIDÁCTICA

Especialización en Finanzas

Versión: Semestre 02/2010

<b>ASIGNATURA</b>	PORTAFOLIO DE RENTA VARIABLE		
<b>MODALIDAD</b>	<b>PRESENCIAL</b>	<b>Nº GRUPO</b>	<b>FECHA DE INICIO:</b> Octubre 8 A Noviembre 6/2010
<b>PROFESOR:</b>	FERNANDO DE JESÚS FRANCO CUARTAS.	<a href="mailto:ffrancoc@une.net.co">ffrancoc@une.net.co</a>	<a href="mailto:gaceta@gacetafinanciera.com">gaceta@gacetafinanciera.com</a>

### OBJETIVOS DE LA ASIGNATURA

1. Desarrollar el concepto de diversificación de Markowitz.
2. Analizar la sensibilidad del mercado de renta variable
3. Estructurar los portafolios de renta variable en tiempo real.
4. Gestionar los portafolios de renta variable en tiempo real.

### CRONOGRAMA DE TRABAJO PARA LA ASIGNATURA



Fecha	Unidad temática	Subtema por abordar en cada unidad	Tipo de evaluación y porcentaje	Observaciones
Octubre 8	Variables Estocásticas.	Riesgo. Clases de riesgo. Identificación y medición. Medidas de tendencia central y de dispersión. Árboles de decisión.	Ensayo individual. Valor 20%	Fecha de entrega. Octubre 16. Sustentable.
Octubre 16	Simulación y Optimización de portafolios en renta variable.	Estructuración y diversificación. Análisis de regresión lineal, correlacional y de varianza mínima. Modelación y Simulación en Excel: Solver. VaR, CAPM.	Portafolio Rv. Valor 30%	Fecha de entrega. Octubre 30. En grupo.
Octubre 23	Banca de inversión	Bocas. Ampliación de capital. VTS. Operaciones simultáneas. Análisis técnico fundamental.	Taller. Valor 20%.	Fecha de Entrega. Noviembre 5..
Nov.6	Retroalimentación	Acumulativa	Valor 30%	Aula informática. Individual.

**ESTRATEGIA METODOLÓGICA**

1. Exposición magistral de todas las unidades.
2. Acceso a plataforma virtual: [www.gacetafinanciera.com](http://www.gacetafinanciera.com)
3. Casos talleres y consultas por parte de los participantes como se anota en la tabla anterior.
4. Modelación y simulación en Excel. Acceso en tiempo real a NYSE.
5. Asesoría vía e-mail.

**BIBLIOGRAFÍA DE APOYO**

1. Pinilla, Roberto. Operaciones en el Mercado de Capitales. Correval SCB. Tercera edición 2008.
2. Álvarez, Alfonso. Análisis bursátil. Editorial Limusa. 2005.
3. Cruz, Sergio. Finanzas corporativas. Teoría y Práctica. Thomson. 2004.
4. Weston, Copeland. Finanzas en administración. Vol. 1. Novena edición. McGraw Hill. Prentice Hall.
5. Moyer, Charles. McGuigan James. Kretlow William. Administración Financiera Contemporánea. Soluciones empresariales.
6. Ketelhohn, Werner. Marín Nicolás. Inversiones. Análisis de inversiones estratégicas. Norma.
7. Kolb, Robert. Inversiones. Limusa. 1996
8. Hull, John. Introducción a los mercados de futuros y opciones. Prentice Hall. 2004
9. [www.gacetafinanciera.com](http://www.gacetafinanciera.com)

Firma del estudiante:	<p style="text-align: center;">Profesor.</p>  <p style="text-align: center;">  </p>
-----------------------	--