



GUÍA DIDÁCTICA

Especialización en Finanzas

Versión: Semestre 01/2009

ASIGNATURA	PORTAFOLIO DE RENTA VARIABLE		
MODALIDAD	PRESENCIAL	Nº GRUPO	FECHA DE INICIO: Marzo 27 A Mayo 8/2009
PROFESOR:	FERNANDO DE JESÚS FRANCO CUARTAS.	ffrancoc@une.net.co	gaceta@gacetafinanciera.com

OBJETIVOS DE LA ASIGNATURA

1. Desarrollar el concepto de diversificación de Markowitz.
2. Analizar la sensibilidad del mercado de renta variable
3. Estructurar y 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
Marzo 27.	Variables Estocásticas.	Riesgo. Clases de riesgo. Identificación y medición. Medidas de tendencia central y de dispersión. Árboles de decisión.	Lectura individual Inglés. Valor 20%	Fecha de entrega. Abril 3. Sustentable.
Marzo 28.	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. Abril 12. En grupo.
Abril 24	Banca de inversión	Bocas. Ampliación de capital. VTS. Operaciones simultáneas. Análisis técnico fundamental.	Taller. Valor 20%.	Fecha de Entrega. Mayo 2.
Mayo 8.	Retroalimentación	Acumulativa	Valor 30%	Aula informática. Individual.

ESTRATEGIA METODOLÓGICA

1. Exposición magistral de todas las unidades.
2. Acceso a plataforma virtual: 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. Cruz, Sergio. Finanzas corporativas. Teoría y Práctica. Thomson. 2004
2. Weston, Copeland. Finanzas en administración. Vol. 1. Novena edición. McGraw Hill. Prentice Hall.
3. Brealey, Richard. Myers Stewart. Marcus Alan. Fundamentos de Finanzas Corporativas. McGraw Hill.
4. Moyer, Charles. McGuigan James. Kretlow William. Administración Financiera Contemporánea. Soluciones empresariales.
5. Ketelhohn, Werner. Marín Nicolás. Inversiones. Análisis de inversiones estratégicas. Norma.
6. Block, Stanley B. Hirt Geoffrey. Fundamentos de Gerencia Financiera. McGraw Hill.
7. Kolb, Robert. Inversiones. Limusa. 1996
8. Hull, John. Introducción a los mercados de futuros y opciones. Prentice Hall. 2004
9. www.gacetafinanciera.com

<p>Firma del estudiante:</p>	<p>Profesor.</p>  
------------------------------	--