



DIPLOMADO | SEMIPRESENCIAL

ALIADO: 

# MERCADO DE CAPITALES

## CONTENIDO TEMÁTICO

### **Módulo 1.**

#### **MARCO REGULATORIO DEL MERCADO DE VALORES COLOMBIANO**

- Concepto y objeto de la autorregulación.
- Funciones de la autorregulación.
- Sujetos susceptibles a ser autorregulados: de carácter obligatorio y de carácter voluntario.
- Entidades autorizadas para actuar como organismos autorreguladores.
- Proceso disciplinario ante AMV.
- Sanciones.
- Deberes y Conductas.

### **Módulo 2.**

#### **MERCADO DE RENTA FIJA**

- Conceptos básicos:
- Cálculo de instrumentos.
- Títulos de Deuda Pública Conceptos, Características y Valoración.
- Otras clases de títulos de renta fija: Conceptos, Características y Valoración.
- Riesgos involucrados en el mercado de renta fija.
- Escalas de calificación en títulos de renta fija.

### **Módulo 3.**

#### **MERCADO DE RENTA VARIABLE**

- Introducción al mercado de acciones.
- Conceptos generales sobre acciones.
- Funciones económicas de una acción.
- Concepto de rentabilidad de las acciones.
- Acciones: características.
- Análisis Fundamental.
- Análisis Técnico.

### **Módulo 4.**

#### **MERCADO DE DIVISAS**

- Marco regulatorio del mercado de divisas.
- Participantes en el mercado cambiario.
- Funcionamiento y operación del mercado de divisas.
- Instrumentos para la intervención cambiaria por parte del Banco Central.
- Operaciones en el mercado cambiario.
- Negociación de operaciones sobre divisas.

### **Módulo 5.**

#### **MERCADO DE DERIVADO**

- Conceptos Teóricos.
- Mercado de Derivados en Colombia.
- Futuros estandarizados (Índices; Acciones; TRM; OIS).
- Opciones Estandarizadas.
- Mercado OTC: Forward, Swaps.
- Gestión de Riesgo de instrumentos Derivados.

### **Módulo 6.**

#### **ESTRUCTURA DE PORTAFOLIOS**

- Concepto de Portafolio.
- Políticas de inversión.
- Operaciones de naturaleza apalancada en los fondos de inversión colectiva.
- Gestión de portafolio: optimización de portafolios, beneficios de la diversificación, estrategias de seguimientos de índices, alpha.
- Medidas de desempeño: coeficientes de variación, sharpe, eficiencia, volatilidad, VaR, benchmark o tasa de referencia.

### **Módulo 7.**

#### **RIESGOS FINANCIEROS**

- Conceptos generales
- sistema de administración de riesgo de mercado (SARM).
- sistema de administración de riesgo de CONTRAPARTE (SARiC).
- sistema de administración de riesgo de liquidez (SARL).

### **Módulo 8.**

#### **TUTORÍAS Y SIMULADOR VIRTUAL - MAESTRO BURSÁTIL // PREPARACIÓN AMV**

- E-Book Operador Básico.
- Tutoriales de Capacitación Operador Básico.
- Exámenes de Simulación Operador Básico.