

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 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 3.

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 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 derivados.

- 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.