

# Educación Continua

TECNOLÓGICO DE MONTERREY



Diplomado

Finanzas Bursátiles Aplicadas



Tecnológico  
de Monterrey

## Objetivo

Aprende el funcionamiento de los mercados financieros nacionales e internacionales. Conoce y experimenta una situación real del trabajo diario de un administrador de inversiones, de riesgos, operador de mesa, analista bursátil, asesor financiero y personal de apoyo.

## Beneficios del programa:

- Comprenderás el marco regulatorio y funcional de los mercados financieros nacionales establecidos, como el BMV y el MEXDER.
- Evaluarás diversos instrumentos financieros: divisas, acciones, bonos, *forwards*, futuros, opciones, *swaps* y notas estructuradas.
- Aplicarás los fundamentos de la teoría de portafolios (CAPM, APT y Markowitz) y estrategia de inversión.
- Comprenderás las medidas de desempeño aplicadas a los portafolios de inversión para su comparación en riesgo y rendimiento.
- Evaluarás el riesgo de portafolios medianamente complejos por las metodologías de valor en riesgo (paramétrico, histórico y Monte Carlo) y pruebas de estrés.
- Realizarás análisis bursátil básico por metodología fundamental y técnica.
- Realizarás los cálculos, el análisis y el desarrollo de sistemas en Excel y VBA de forma ágil, ordenada y automatizada.
- Obtendrás las habilidades para desempeñarte en cualquier área de las finanzas bursátiles.

## Dirigido a:

Licenciados en finanzas, contabilidad y economía.

## Contenido del programa

El Diplomado en Finanzas Bursátiles Aplicadas consta de **nueve módulos**, que suman **140 horas** de estudio en total.

### Módulo 1. Introducción a los Mercados de Valores

(12 horas)

- Mercados globales y organismos internacionales
  - Sistema financiero mexicano
  - Bolsa Mexicana de Valores y Mercado Mexicano de Derivados
  - Conceptos básicos del mercado accionario
  - Conceptos básicos del mercado de divisas
- 

### Módulo 2. Excel y *Visual Basic for Applications*

(24 horas)

- Funciones lógicas y estadísticas, matriciales y de búsqueda
  - Tablas dinámicas
  - *Solver* y herramientas de análisis
  - Elaboración de gráficos
  - Introducción a VBA
  - Objetos, métodos y propiedades
  - Fundamentos de programación
  - Estructuras de control
  - Interfaz de usuario
  - Casos
- 

### Módulo 3. Matemáticas Financieras, Probabilidad y Estadística

(12 horas)

- Introducción a las matemáticas financieras
- Valor del dinero a través del tiempo
- Estadística descriptiva
- Probabilidad
- Conclusiones y evaluaciones

## Módulo 4. Administración de Inversiones

(16 horas)

- Fundamentos de la administración de inversiones
  - Objetivo, universo y políticas de inversión
  - Evaluación del desempeño y *benchmarking*
  - Modelos de CAPM y de Markowitz
  - Riesgo específico y de mercado
  - Estrategias de inversión
- 

## Módulo 5. Instrumentos de Deuda

(16 horas)

- Análisis matemático y analítico de los instrumentos de deuda
  - Instrumentos de renta fija
  - Curvas de interés
  - Introducción a las medidas de riesgo de tasa de interés
- 

## Módulo 6. Instrumentos Derivados

(20 horas)

- Introducción a los mercados derivados
  - *Forwards*
  - Futuros
  - SWAPS
  - Opciones
- 

## Módulo 7. Administración de Riesgos

(16 horas)

- Introducción a la administración de riesgos
- Convenios de Basilea
- Tipos de riesgo
- Valor en riesgo por metodología paramétrica
- Valor en riesgo por simulación histórica
- Valor en riesgo por simulación Monte Carlo
- *Backtesting* y pruebas de estrés

## **Módulo 8.** Análisis Bursátil

(16 horas)

- Introducción a las metodologías de análisis bursátil
  - Análisis fundamental
  - Análisis técnico
- 

## **Módulo 9.** Dinámica de Esferas

(8 horas)

- Simulador

***Permítenos asesorar tu trayectoria profesional, será un gusto atenderte personalmente.***