

Diplomado en Mercados de Capitales y Banca

Presencial apoyada en el modelo PAT

PRESENTACIÓN

El actual contexto global post-COVID junto con la revolución de las tecnologías emergentes y el desarrollo de la Economía Digital, se han generado grandes cambios en el comportamiento de los mercados de capitales y la banca, generar tanto grandes oportunidades como nuevos riesgos. La comprensión profunda y práctica del funcionamiento y los instrumentos de estos mercados, permite a profesionales y empresas sacar partido de estas situaciones y mejorar la toma de decisiones.

OBJETIVOS DEL PROGRAMA

GENERAL

Dar al participante conocimientos del funcionamiento del mercado de capitales, la banca y sus principales instrumentos, con una perspectiva moderna y comprensión en la valoración de diferentes tipos de activos y contratos, y generar capacidades de análisis

ESPECÍFICOS

- Comprender el funcionamiento de la banca, los mercados de capitales, los agentes involucrados y su principal regulación.
- Aprender las bases de matemática financiera que permitirán generar capacidades de análisis en la valoración de instrumentos financieros.
- Desarrollar conocimientos del funcionamiento y los principales instrumentos en la banca y de los mercados de renta fija, renta variable y derivados.
- Realizar la valoración de instrumentos financieros a través de modelos en Excel.
- Realizar análisis de rentabilidad-riesgo de diversos instrumentos financieros.
- Comprender los principales riesgos a los que se someten las instituciones financieras: riesgo de crédito, de mercado y de liquidez.

PERFIL DEL INTERESADO

Profesionales de áreas financieras y económicas, estudiantes de ciencias empresariales, gerentes de área, ejecutivos financieros, empresarios y personas que trabajen en el sector financiero, bancos, fiduciarias, etc o que quieran mejorar su perfil profesional para trabajar en él.

METODOLOGÍA

Curso de metodología presencial:

- Conferencias del profesor orientadas a presentar los conceptos fundamentales de los temas.
- Ayudas didácticas y talleres con uso de la plataforma Bloomberg, plataformas especializadas de mercados de capitales (Investing, Finviz y, TIKR), páginas web y presentación de conferencista.
- Se analizarán casos reales y de coyuntura actual de los mercados de capitales.

Módulo

Contenido

Intensidad

1	INTRODUCCIÓN A LOS MERCADOS Y LA BANCA	<ol style="list-style-type: none"> 1. Qué son los mercados financieros 2. Mercado intermediado (bancario) y no intermediado (bursátil) 3. Agentes del mercado bancario 4. Mercado OTC y mercado bursátil 5. Intervenientes en los mercados de capitales 6. Normatividad y regulación general 	3 horas
----------	---	--	----------------

2	MATEMÁTICAS FINANCIERAS APLICADAS	<ol style="list-style-type: none"> 1. El concepto de inversión y su relación con los intereses 2. Manejo de tasas de interés <ol style="list-style-type: none"> a. Interés simple e interés compuesto b. Tasas de interés nominales y efectivas c. Interés anticipado y vencido 3. Valor del dinero en el tiempo <ol style="list-style-type: none"> a. Valor Presente (VP) b. Valor Futuro (VF) c. Cálculo de cuotas o anualidades 	6 horas
----------	--	---	----------------

3	NEGOCIO BANCARIO E INSTRUMENTOS	<p>El negocio bancario</p> <p>Instrumentos de crédito:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Crédito de libre inversión - Tarjeta de crédito - Crédito hipotecario (en pesos y UVR) - Créditos empresariales - Leasing: de activos muebles e inmuebles <p>Ejercicios aplicados de amortización de créditos y leasing.</p> <p>Instrumentos de ahorro, inversión y fiduciarios:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Negocio fiduciario y tipos de fiducia - Instrumentos de ahorro: CDT's y otros certificados - Fondos de inversión colectiva (FIC) 	9 horas
----------	--	--	----------------

4	BANCA DIGITAL	<p>Un nuevo modelo de negocio digital</p> <p>Características y tipos de servicios</p> <p>Ejemplos fintech y nuevas tecnologías</p> <p>Large Challengers, Neobancos y bancos digitales.</p>	3 horas
----------	----------------------	--	----------------

5	MERCADO DE RENTA FIJA	<ol style="list-style-type: none"> 1. Estructura de pagos de los bonos: cupones, nominal, precio, rendimiento. 2. Instrumentos de Renta Fija a tasa fija y a tasa variable 3. Instrumentos que se negocian al descuento o con prima 4. Títulos de deuda pública - TES 5. Títulos de deuda privada o corporativos 6. Titularizaciones 7. Otras clases de títulos de renta fija 8. Valoración a precios de mercado de la renta fija <ol style="list-style-type: none"> a. Precio sucio b. Interés acumulado o corrido c. Precio limpio 9. Curvas de rendimientos: aplanamiento, desplazamiento, empinamiento. 	15 horas
----------	------------------------------	--	-----------------

6	MERCADO DE RENTA VARIABLE	<ol style="list-style-type: none"> 1. Introducción al mercado de acciones 2. Conceptos generales sobre acciones <ol style="list-style-type: none"> a. Tipos: ordinarias, preferenciales, privilegiadas b. Beneficios económicos y políticos c. ADRs y GDRs 3. Otros mercados de renta variable <ol style="list-style-type: none"> a. Mercado Global Colombiano b. Mercado MILA c. ETFs - Exchange Traded Funds (Fondos Bursátiles) d. Fondos de inversión colectiva - FIC's y unidades de participación de fondos (inmobiliarios, de capital privado, etc.) e. Mercados internacionales 4. Concepto de rentabilidad y riesgo de las acciones <ol style="list-style-type: none"> a. Rentabilidad: rendimiento, dividend yield, retorno b. Riesgo: volatilidad de una acción y un portafolio de acciones c. Conceptos clave del modelo de media-varianza 5. Valoración de renta variable <ol style="list-style-type: none"> a. Modelo de valoración de activos de capital - CAPM b. Conceptos de valoración por flujos de caja descontados c. Conceptos de valoración por múltiplos 	15 horas
----------	----------------------------------	--	-----------------

7	MERCADO DE DERIVADOS	<ol style="list-style-type: none"> 1. Conceptos básicos y funcionamiento del mercado 2. Derivados estandarizados <ol style="list-style-type: none"> a. Funcionamiento de la Bolsa b. Cámara de riesgos y uso de garantías 3. Derivados OTC <ol style="list-style-type: none"> a. El papel de intermediario financiero b. Contrato marco de derivados 4. Función de los derivados como instrumentos de cobertura y de inversión 5. Definición y valoración de instrumentos <ol style="list-style-type: none"> a. Forwards: forward FX, FRAs y otros b. Swaps: IRS y CCS c. Futuros: Acciones, COLCAP, TRM y TES de referencia específica d. Opciones: Call y Put, Europeas y Americanas 	15 horas
----------	-----------------------------	--	-----------------

8	RIESGOS EN LOS MERCADOS	<ol style="list-style-type: none"> 1. Riesgo de mercado <ol style="list-style-type: none"> a. Conceptos de riesgo de mercado b. Valor en riesgo (VaR) de renta variable c. Duración y Convexidad d. Valor en riesgo (VaR) de renta fija 2. Riesgo de liquidez <ol style="list-style-type: none"> a. Conceptos clave de riesgo de mercado b. Liquidez asociado al flujo de caja y asociado al mercado c. Indicador de Riesgo de Liquidez - IRL. d. Modelos de riesgo de liquidez 3. Riesgo de Crédito (emisor y contraparte) <ol style="list-style-type: none"> a. Tipos de riesgo de crédito b. Factores de riesgo de crédito: probabilidad de incumplimiento, exposición y pérdida dado el incumplimiento. c. Medición de la probabilidad de incumplimiento d. Calificaciones de riesgo 4. Riesgos ASG (ambientales, sociales y de gobernanza) 	15 horas
----------	--------------------------------	--	-----------------

EQUIPO DOCENTE

Expertos en esta área del conocimiento



JOSÉ FERNANDO MEJÍA VILLA

COORDINADOR ACADÉMICO

Ingeniero Industrial con Maestría en Finanzas y certificado como Financial Risk Manager - FRM®. Consultor financiero, empresario y profesor. Experiencia en cargos de responsabilidad y consultoría financiera en empresas como el Instituto Nacional de Vías - INVIAS, Banco Santander (España), Repsol (España), Gas Natural y el Acueducto de Bogotá. Actualmente Director Ejecutivo en 21 Trading Coach, empresa de formación y consultoría especializada en finanzas. Más de 13 años de experiencia docente como profesor de posgrado en universidades como el Rosario, Javeriana, CESA, EAFIT y Universidad de La Sabana.



DIEGO PALACIOS

DOCENTE

Administrador de Empresas con Master en Administración y Dirección de Negocios con énfasis en finanzas y análisis económico. 10 Años de experiencia en el mercado financiero y bursátil desempeñándose como Trader de renta variable y renta fija en Colombia, Portfolio Manager de Fondos Locales y Globales en Firmas comisionistas de bolsa y Estratega Senior de Trading de commodities agrícolas en brokers en Chicago Illinois en empresas del Sector real Colombiano. Actualmente es Docente de la Pontificia Universidad Javeriana para la facultad de Ciencias Económicas y Administrativas en temas relacionados con valoración de inversiones y mercados.



IVÁN FELIPE RICO

DOCENTE

Maestría en Economía y Finanzas (Skovde, Suecia) e Ingeniero Industrial de la Universidad de Los Andes. Experiencia profesional como gerente de inversión en Asesores en Valores y otras entidades como Proyectar Valores, Banco de Bogotá y Legis. Actualmente profesor de docencia en la Universidad del Rosario y director de la Maestría en Finanzas. Experiencia docente de más de 15 años en Universidad del Rosario, La Sabana, Javeriana, entre otras.

RECURSOS TECNOLÓGICOS

Uso de la plataforma Webex. Todos los docentes y estudiantes deberán tener un buen acceso a internet, sonido y cámara para poder facilitar las sesiones.

CERTIFICADOS

La Universidad Ean expide un certificado por participación a quienes asistan al 80% de las sesiones programadas.

Los certificados se generan y entregan únicamente a aquellos participantes que hayan cumplido con la cantidad mínima de horas según requerido en la presente propuesta.

DURACIÓN

81 horas

