

DIPLOMADO EN ADMINISTRACIÓN
DE PORTAFOLIOS DE INVERSIÓN
AULA VIRTUAL
(28 horas)

Objetivo:

- Reconocer la importancia de una correcta administración de un portafolio de inversión que sirva para asignar estratégicamente los recursos financieros de la empresa.

Dirigido a:

- Directivos, contadores, financieros y economistas.

Reconocimiento:

- Al finalizar tu programa recibirás:
 - **Diploma Digital** con **validez curricular** y **tecnología Blockchain** con código QR y de verificación.
 - Certificado **International Coaching and Consulting Network**.
 - Constancia DC-3 por la STPS
 - Insignia digital de tu programa para compartir en tus redes sociales

¿Por qué UVM?

Tenemos **más de 60 años** de **experiencia académica**, más de **150 programas educativos** y más de **180 programas de excelencia** a nivel nacional.

Adquieres **conocimientos** y **habilidades esenciales** que puedes **aplicar de inmediato** en tu **actividad profesional**.

Los **profesores** que imparten las **Certificaciones y Diplomados** son **expertos reconocidos** en sus campos.

Tienes **flexibilidad educativa** que te permite **estudiar a tu ritmo**, a **cualquier hora** y en **cualquier lugar**.

Los **Diplomados y Certificaciones UVM** enriquecen tu **CV** y te posicionan como **el mejor candidato**.

Al estudiar el programa podrás:

Comprender los enfoques de valuación y análisis de deuda y acciones.



Estimar el impacto de los riesgos más importantes en la cartera: tasa de interés y cambiario.



Definir indicadores para medir el desempeño de un portafolio.



Aplicar la teoría de portafolios para crear carteras eficientes.



MÓDULOS

01 Decisiones de inversión, consideraciones básicas

1. Elementos de las decisiones de inversión
 - a. Antecedentes
 - b. Tipos de inversión
 - c. Mercados e instrumentos de inversión
 - d. Procesos de inversión
 - e. Manejo de tasas de interés
2. Teoría básica de portafolios de inversión
 - a. Metas de inversión
 - b. Parámetros de inversión:
 - i. Riesgo
 - ii. Rendimiento
 - iii. Vencimiento
 - iv. Negociabilidad
 - v. Liquidez
 - c. Diversificación eficiente
 - i. Teoría del mercado de capitales
3. Introducción al mercado de dinero de México
 - a. Bonos gubernamentales
 - b. Introducción al mercado cambiario
 - c. Proyección del tipo cambiario

02 Valuación de activos, análisis fundamental y análisis técnico

1. Valuación de activos, análisis fundamental y análisis técnico
2. Top-down
3. Bottom-up
4. Análisis del mercado
5. Análisis de la industria
6. Análisis de la empresa
7. Ratios
8. Tendencias del mercado y gráficas de precios
9. ¿Qué comprar/vender?
10. ¿Cuándo comprar/vender?

03 Valuación de instrumentos de renta fija

1. Instrumentos de renta fija
 - a. Públicos
 - b. Privados
2. Valuación de instrumentos de renta fija
3. Teoría clásica: duración
 - a. Duración de Macaulay
 - b. Duración modificada
4. Convexidad de la curva de valor intrínseco
5. Consideraciones para la administración de portafolios de renta fija
6. Estrategias de administración de portafolios de bonos:
 - a. Pasivas
 - b. Inmunización de carteras
 - c. Estrategias híbridas

04 Valuación de acciones

1. Valuación de acciones
2. Las acciones comunes vs Acciones preferentes
3. Valuación de acciones con crecimiento 0 y crecimiento constante
4. Modelos de crecimiento de los dividendos (Gordon)
5. Valuación con múltiplos

05 Teoría avanzada de portafolios de inversión

1. Teoría avanzada de portafolios de inversión: Modelo de Markowitz (MPT)
2. Capital Asset Pricing Model (CAPM)
3. Arbitrage Pricing Theory
4. La hipótesis de los mercados eficientes
5. Administración de riesgo y diversificación

06 Evaluación de un portafolio de inversión

1. Evaluación del desempeño de un portafolio de inversión
 - a. Funciones objetivo, restricciones, variables de decisión y estrategias
 - b. Técnicas de evaluación del desempeño
 - c. Métricas clave para evaluar el desempeño de tu portafolio
 - d. Benchmarking
 - e. Herramientas y métodos para la evaluación
 - f. ¿Cómo ajustar tu portafolio basado en la evaluación?
2. Evaluación de inversiones
 - a. Estados financieros para ser usados en la evaluación financiera
 - b. Construcción de ratios financieros
 - c. La tasa de descuento como elemento fundamental del costo de oportunidad
 - d. La tasa interna de retorno y el valor actual neto
 - e. El factor riesgo como elemento decisorio en la toma de decisiones
3. Diversificación internacional
 - a. Inversiones internacionales
 - b. Estrategias activas y pasivas de inversión
 - c. Prospectiva internacional y construcción de escenarios

Beneficios de la modalidad

Clases en vivo, actividades interactivas y casos prácticos. Puedes interactuar con profesores y otros alumnos para tener una experiencia más enriquecedora.

Networking. Tienes la oportunidad de construir una red de contactos profesionales con otras personas que tienen intereses similares o se desempeñan en el mismo ámbito.

Asesoría y acompañamiento. Cuentas con un facilitador por módulo para guiarte durante tu curso.

Aplica lo que aprendas de forma inmediata.

Nota: Si no asistes a las sesiones en vivo con el profesor en las fechas y horarios establecidos, tendrás 10 días naturales para ver completa la grabación de la clase en Teams® y realizar la actividad asignada para que acredites el módulo.

SÉ PARTE DE LA UVM



@uvmmx



uvm



@uvmmx



uvm.mx