|  |
| --- |
| **MODULO 1: VALORACIÓN Y FINANZAS CORPORATIVAS.** |
| **Objetivos:** Como objetivo general, este módulo pretende que los alumnos adquieran destrezas para la valoración de activos financieros en carteras, con especial énfasis en el tratamiento del riesgo.  **1. Valoración** • Valoración de bonos. • Valoración de acciones. • Valoración de empresas.  **2. Análisis de Riesgo** • Análisis probabilístico. • Análisis de sensibilidad y de escenarios. • Simulación de Montecarlo.  **3. Teoría de Portafolios** • Medición del riesgo. • Cálculo de la varianza. • Portafolio eficiente. • Modelo de Markowitz.  **4. CAPM** • Supuestos y derivación. • Medición y predicción de los betas. • Interpretación de los alfas y R2. • CAPM de múltiples factores y APT. • CAPM internacional. |
|  |