

Introducción

- Herramientas Estadísticas & Probabilísticas
- Aversión al Riesgo
- Activos Riesgosos & Libre de Riesgo
- Teoremas de Arrow-Pratt
- Separación Monetaria de Dos Fondos

Dominancia Estocástica

- Dominancia Estocástica de Primer Orden
- Dominancia Estocástica de Segundo Orden

Matemática del Portafolio Frontera

- Modelo de Media-Varianza
- Elección de Portafolios Optimos
 - Derivación & Propiedades de la Frontera de Portfolios Optimos
 - Frontera con Activo Libre de Riesgo

Separación de Dos Fondos

- Valuación Lineal & Separación de Dos Fondos
 - Separación de Un Fondo
- Equilibrio en el Mercado de Activos
- CAPM (Capital Asset pricing Model)
- APT (Arbitrage Pricing Model)

Valuación de Activos Riesgosos

- Procesos Estocásticos
- Lema de Ito
- Ecuaciones de Bellman
- Inversión bajo Incertidumbre
- Problemas de Entrada y salida de firmas.

Opciones

- Derivados: Call & Put
- Modelo de Black & Scholes
- Derivación del Precio de distintos tipos de Opciones
- Letras Griegas

Bonos

- Zero Coupon Bond
- One factor interest rate modelling
- Two factor interest rate modelling
- Bonos con cupones
- Duración

Forwards & Futures

- Descripción
- Aplicaciones

Bonos Corporativos

- Deuda corporativa
- Riesgo de Default

Value at Risk

- Linear VaR
- Non Linear VaR

Bibliografia

1. Foundations for Financial Economics, Chi-fu Huang & Robert H. Litzenberger. Prentice Hall, 1988.
2. Introduce Quantitative Finance, Paul Wilmott. Wiley, 1988.
3. Options, Futures & other Derivatives, Hull. Prentice Hall.
4. Financial Theory & Corporate Policy, Copeland & Wetson. Addison Wesley.
5. Derivatives: The Theory & Practice of Financial Engineering, Paul Wilmott. Wiley, 1998