



**PROGRAMA DE POSGRADO EN INGENIERÍA**  
CAMPO DEL CONOCIMIENTO DE INGENIERÍA DE SISTEMAS  
MAESTRÍA EN PLANEACIÓN



## EVALUACIÓN DE MERCADOS DE CAPITAL

**Campo:** Básico

**Duración del Curso**

**Horas a la semana**

**Créditos:** 6

**Semanas:** 16

**Horas:** 48

3

### OBJETIVO:

Estudiar y analizar las teorías y modelos existentes para el análisis, evaluación e identificación de los parámetros que rigen el comportamiento de los activos en mercados de capital; en particular, se mostrará y discutirá su aplicación en el mercado nacional.

### CONTENIDO TEMÁTICO:

1. INTRODUCCIÓN
2. TEORÍA DE LA ESPECULACIÓN
3. COMPORTAMIENTO DE LOS PRECIOS DE LAS ACCIONES
4. CONSTRUCCIÓN DE PORTAFOLIOS DE INVERSIÓN
5. RECONOCIMIENTO DE PATRONES EN SERIES DE TIEMPO FINANCIERAS

### BIBLIOGRAFÍA

- I. Black Fischer; Scholes Myron, "From Theory to a New Financial Product". The Journal of Finance, Vol. 29, No. 2, Papers and Proceedings of the Thirty – Second Annual Meeting of the American Finance Association, New York, New York, December 28-30, 1973 (May, 1974), 399-412.
- II. Courtault Jean-Michel; Kabanov Yuri, "Louis Bachelier On the centenary of "Théorie de la Spéculation". Mathematical Finance, Vol. 10 No. 3 (July 2000), 341-353.
- III. Case James, "The Modeling and Analysis of Financial Time Series", The American Mathematical Monthly, Vol. 105, No. 5. (May, 1998), pp. 401-411.
- IV. Brown Stephen J., Goetzmann William Peter, Kumar Alok, "The Dow Theory: William Peter Hamilton's Track Record Reconsidered", The Journal of Finance, Vol. 53, No. 4, Papers and Proceedings of the Fifty-Eighth Annual Meeting of the American Finance Association, Chicago, Illinois, January 3-5. 1998 (Aug., 1998), 1311-1333.
- V. Fama Eugene F., "The behavior of Stock-Market Prices". The Journal of Business,



**PROGRAMA DE POSGRADO EN INGENIERÍA**  
CAMPO DEL CONOCIMIENTO DE INGENIERÍA DE SISTEMAS  
MAESTRÍA EN PLANEACIÓN



Vol. 38, No.1 (Jan., 1965), 34-105.

- VI. Markowitz Harry, "Portfolio Selection". The Journal of Finance, Vol. 7, No.1 (Mar., 1952), pp. 77-91.
- VII. Rubinstein Mark, "Markowitz's "Portafolio Selection": A Fifty-Year Retrospective", The Journal of Finance. Vol. LVII, No3, June 2002.
- VIII. Sharpe William F., "A Simplified Model for Portfolio Analysis", ...
- IX. Rutovitz Denis, "Pattern Recognition", Journal of the Royal Statistical Society. Series A (General), Vol. 129, No. 4. (1966), pp. 504 -530.
- X. Lo, Andrew W.; Mamaysky, Harry; Wang, Jiang, "Foundations of Technical Analysis: Computational Algorithms, Statistical Inference, and Empirical Implementation", The Journal of Finance, Vol. 55, No. 4, Papers and Proceedings of the Sixtieth Annual Meeting of the American Finance Association, Boston, Massachusetts, January 7-9, 2000. (Aug., 2000), pp. 1705-1765.