

DERIVADOS FINANCIEROS Y ESTRATEGIAS DE COBERTURA

120 puntos *Valido también para puntos Mexder

Duración: 60 horas.

Objetivo general:

Identificar las particularidades de los Contratos Derivados Bursátiles y Extrabursátiles, para evaluar sus ventajas operativas y los riesgos asociados de cada posición, considerando las condiciones de contratación de acuerdo al Mexder y OTC.

TEMARIO

1. Plataformas y Operaciones de Derivados en México.

- 1.1 Historia y Desarrollo de la plataforma de Derivados Financieros.
- 1.2 Cobertura y Especulación con Forwards.
- 1.3 Instrumentos Derivados Fundamentales: Futuros, Opciones y Swaps.
- 1.4 Comparativa entre Mercados Financieros Organizados y OTC.
- 1.5 Comparación de Beneficios y Riesgos entre los Mercados Financieros Organizados y no Estandarizados.

2. Especificaciones y términos de Contratos de Cobertura Futura.

- 2.1 Estrategias de Posición en Contratos de Derivados Futuros.
- 2.2 Riesgo de cobertura y costos de almacenamiento del Portafolio.
- 2.3 Estimación del valor de Contratos de Cobertura Futura y Forwards.
- 2.4 Disposiciones fundamentales del establecimiento del contrato.
- 2.5 Evaluación de ganancias y déficits en estrategias largas y cortas.

3. Especificaciones y términos de negociación de las Opciones Financieras.

- 3.1 Análisis comparativo entre contratos de Futuro y Opción.
- 3.2 Elementos clave.
- 3.3 Diferenciación de Contratos de Opción de acuerdo a sus condiciones de ejecución.
- 3.4 Operaciones básicas en contratos de Opción: Call y Put.
- 3.5 Escenarios de mercado según la estrategia en Opciones y Activos Subyacentes.
- 3.6 Categorización de opciones por su relación con el precio de ejercicio: ITM, ATM y OTM.
- 3.7 Condiciones estándar establecidas para la Contratación de Opciones.
- 3.8 Uso de la relación Put-Call para construir Posiciones Sintéticas (Call Sintético, Put Sintético, Posiciones Largas y Cortas Lineales).

4. Determinación de Valor de Contratos de Futuros y Opciones.

- 4.1 Estimación de precios de Contratos de Futuros.
- 4.2 Estimación de precios de Contratos de Opción.
- 4.3 Fluctuación de precios.
- 4.4 Estimación de las variaciones de sensibilidad estadísticas.
- 4.5 Relación de precios entre Opciones Put y Call.

5. Planes de Cobertura utilizando Derivados.

- 5.1 Estrategias de protección mediante Contratos de Futuros.
- 5.2 Estrategias de protección mediante Contratos con Opciones.
- 5.3 Tácticas y formaciones de Productos Derivados.

6. Gestión de Amenazas Financieras.

- 6.1 Diversos Riesgos en las Finanzas.
- 6.2 Fundamentos de rendimiento y fluctuación en Activos Financieros a través de las métricas de dispersión financiera.
- 6.3 Medición del riesgo en Instrumentos Financieros y Portafolios mediante el Valor en Riesgo (VaR).
- 6.4 Aspectos complementarios sobre riesgos.
- 6.5 Solidez crediticia y entidades de calificación financiera.