

MicroCourse Aplicaciones Financieras
Rúbrica de Evidencia final

Objetivo: Diseñar e implementar modelos de pronósticos de valores esperados, futuros de rendimientos y precios de activos financieros, así como del portafolio en su conjunto.

Criterios de evaluación	Nivel de desempeño			%
	Altamente competente 100%-86%	Competente 85%-70%	Aún sin desarrollar la competencia 69%-0%	
1. Selección y análisis de empresas.	20 - 17	16 - 14	13 - 0	20
	Selecciona 10 empresas de distintas industrias, analiza y justifica su elección con claridad. Utiliza datos históricos de forma adecuada para el análisis.	Selecciona 10 empresas, pero la justificación o la diversificación de industrias no es clara o completa. El análisis de los datos históricos es adecuado pero superficial.	Selecciona menos de 10 empresas o la selección es poco diversificada. El análisis de datos históricos es insuficiente o incorrecto.	
2. Aplicación del modelo CAPM y análisis de rendimiento.	25 - 21	20 - 17	16 - 0	25
	Aplica correctamente el modelo CAPM de cinco factores, presenta y analiza los resultados de forma clara y detallada, clasificando las empresas de acuerdo con su rendimiento esperado.	Aplica el modelo CAPM con pequeños errores o imprecisiones. La presentación de resultados es adecuada pero la interpretación es básica.	Aplica incorrectamente el modelo CAPM o la interpretación de resultados es incoherente o muy superficial.	
3. Simulación Monte Carlo y pronóstico de precios.	25 - 21	20 - 17	16 - 0	25
	Realiza una simulación Monte Carlo precisa y detallada, con una excelente interpretación de los resultados y pronósticos futuros. La gráfica de rutas estimadas es clara y completa.	Realiza la simulación Monte Carlo con algunos errores menores o simplificaciones. La interpretación de los resultados es adecuada, pero falta detalle.	La simulación Monte Carlo es incorrecta o los resultados son interpretados de manera inadecuada. La gráfica de rutas estimadas es confusa o incompleta.	
	15 - 13	12 - 10	9 - 0	15

4. Valor en riesgo (VaR) y análisis de riesgo.	Calcula y analiza el VaR de forma excepcional, con una explicación detallada y gráficas claras que muestran los retornos diarios y los posibles valores del portafolio.	Calcula el VaR correctamente, pero el análisis es superficial o las gráficas son poco claras o incompletas.	El cálculo del VaR es incorrecto o el análisis es incoherente. Las gráficas son inadecuadas o faltan.	
5. Diseño del dashboard interactivo.	15 - 13 Diseña un dashboard interactivo excepcional que muestra claramente todos los elementos requeridos, con una interfaz intuitiva y visualmente atractiva.	12 - 10 El dashboard contiene todos los elementos requeridos, pero el diseño es básico o la interfaz no es totalmente intuitiva.	9 - 0 El dashboard es incompleto, carece de varios elementos requeridos o es difícil de usar.	15
Total				100%