



UNIVERSIDAD NACIONAL AUTÓNOMA DE MÉXICO
 FACULTAD DE CONTADURÍA Y ADMINISTRACIÓN
 PLAN DE ESTUDIOS DE LA LICENCIATURA EN
 ADMINISTRACIÓN
 Programa de la asignatura



Portafolio de Inversiones

Clave:	Semestre: Entre 5° y 8	Área o campo de conocimiento: Finanzas		No. Créditos: 8
Carácter: Optativa de elección profesionalizante		Horas		Horas al semestre
Tipo: Teórica		Teoría:	Práctica:	Horas por semana
		4	0	
Modalidad: Curso		Duración del programa: Semestral		

Seriación: Si () No (x) Obligatoria () Indicativa ()
Asignatura antecedente: Ninguna
Asignatura subsecuente: Ninguna
Objetivo general:
El alumno será capaz de diseñar, seleccionar, evaluar y administrar carteras de inversión empleando las técnicas y modelos para ello, sobre la base de los instrumentos negociados en el mercado de valores.

Índice Temático			
Unidad	Tema	Horas	
		Teóricas	Prácticas
I	Introducción a la teoría de carteras	10	0
II	La teoría de la elección y las decisiones de inversión	16	0
III	Modelo de selección de carteras de markowitz	10	0
IV	Modelo de índice	2	0
V	Capital asset pricing model	10	0
VI	Arbitrage pricing theory	10	0
VII	Evaluación del desempeño de carteras	6	0
Total de horas:		64	

Bibliografía básica:
1. ELTON, Edwin J., Gruber, Martin J., Brown, Stephen and Goetzmann, William N., <i>Modern Portfolio Theory and Investment Analysis</i> , Wiley, 2006, 729 pp.
2. MARKOWITZ, Harry M., <i>Portfolio Selection: Efficient Diversification of Investments</i> , Wiley, 1992, 384 pp.
3. MESSUTI, Domingo Jorge, Alvarez, Víctor Adrián, Graffi, Hugo Romano, <i>Selección de Inversiones: Introducción a la teoría de cartera</i> , Ediciones Macchi, Argentina, 1992, [s.p.]

<p>4. REILLY, Frank K., Brown, Keith C., Reilly, Frank, <i>Investment Analysis and Portfolio Management</i>, South-Western Educational Publishing, 2000, [s.p.]</p> <p>5. SHARPE, William F., <i>Portfolio Theory and Capital Markets</i>, McGraw-Hill Trade, 1999, [s.p.].</p>	
<p>Bibliografía complementaria:</p> <p>1. HULL John C. <i>Introducción a los Mercados de Futuros y Opciones</i>, 4ª edición, Ed. Pearson, México 2002, 560 pp.</p> <p>2. MERCADO H. Salvador, <i>Mercado de Dinero y Mercado de Capitales</i>. Ed. Cengage, México, 2009, 476 pp.</p> <p>3. RUEDA Arturo, <i>Para Entender la Bolsa</i>. Ed. Cengage. 2.ª Edición, México, 2005, 480 pp.</p>	
<p>Sugerencias didácticas:</p> <p>Exposición oral (x)</p> <p>Exposición audiovisual (x)</p> <p>Ejercicios dentro de clase (x)</p> <p>Ejercicios fuera del aula (x)</p> <p>Seminarios ()</p> <p>Lecturas obligatorias (x)</p> <p>Trabajo de investigación (x)</p> <p>Prácticas de taller o laboratorio ()</p> <p>Prácticas de campo ()</p> <p>Otras: _____ ()</p>	<p>Mecanismos de evaluación del aprendizaje de los alumnos:</p> <p>Exámenes parciales (x)</p> <p>Examen final escrito (x)</p> <p>Trabajos y tareas fuera del aula (x)</p> <p>Exposición de seminarios por los alumnos ()</p> <p>Participación en clase (x)</p> <p>Asistencia (x)</p> <p>Seminario ()</p> <p>Otras: ()</p>
<p>Perfil profesiográfico:</p> <p>Estudios requeridos:</p> <p>Tener la Licenciatura en Contaduría, Licenciatura afín o con Maestría en Finanzas.</p> <p>Tener conocimientos a nivel de comprensión del idioma inglés.</p> <p>Tener conocimientos de matemáticas y teoría microeconómica</p> <p>Tener conocimientos en el manejo de sistemas de cómputo y paquetería especializada de Finanzas.</p> <p>Experiencia profesional deseable:</p> <p>Tener experiencia en el sector bursátil o el área de inversiones de instituciones financieras o empresas</p> <p>Tener experiencia docente.</p>	