



UNIVERSIDAD NACIONAL AUTÓNOMA DE MÉXICO

Facultad de Contaduría y Administración

Plan de estudios de la Licenciatura en Contaduría



INTERVAL - FCA – UNAM:

“Riesgos Financieros en los Portafolios”

Clave 901	Semestre 5°- 8°	Créditos 8	Área de conocimiento	Finanzas			
			Ciclo	Área de desarrollo temprano			
Modalidad	Curso ( X ) Taller ( ) Lab ( ) Sem ( )			Tipo	T ( X ) P ( ) T/P ( )		
Carácter	Obligatorio ( )			Horas			
	Optativo de Elección ( X )		Complementario ( ) Profesionalizante ( X )	Semana	Semestre		
				Teóricas	4	Teóricas	64
				Prácticas	0	Prácticas	0
			Total	4	Total	64	

<b>Seriación</b>	
Ninguna ( X )	
Obligatoria ( )	
Asignatura antecedente	Ninguna
Asignatura subsecuente	Ninguna
<b>Indicativa ( )</b>	
Asignatura antecedente	Ninguna
Asignatura subsecuente	Ninguna

**Objetivo general:** El alumno será capaz de identificar los riesgos que presenta un portafolio en los mercados financieros de países emergentes.

**Objetivos específicos:** El alumno:

1. Conocerá las causas y efectos de la globalización económica en América Latina, los efectos sociales, políticos en las economías locales así como la importancia de EEUU en la globalización y sus efectos.
2. Aprenderá el sistema financiero internacional, la importancia en los mercados financieros globales, la estructura de los mercados financieros locales y la inversión extranjera directa.
3. Analizará el concepto de riesgo financiero, el proceso de administración de riesgos, la identificación de los mismos y las herramientas de evaluación.

4. Comprenderá los conceptos de riesgo, su importancia, los factores de riesgo de mercado y su cuantificación			
5. Conocerá los riesgos operativos al momento de crear un portafolio, sus implicaciones, y el modelo de cuantificación de un riesgo en un portafolio.			
Índice temático			
	Tema	Horas Semestre / Año	
		Teóricas	Prácticas
1	Causas y efectos de la Globalización Económica	12	0
2	Formación de los mercados financieros en países emergentes	14	0
3	Importancia y estudio de los Riesgos Financieros	16	0
4	Riesgos de Mercado	12	0
5	Riesgos Operativos al crear un Portafolio	10	
<b>Total</b>		<b>64</b>	<b>0</b>
<b>Suma total de horas</b>		<b>64</b>	

Estrategias didácticas		Evaluación del aprendizaje	
Exposición oral	(X)	Exámenes parciales	(X)
Exposición audiovisual	(X)	Examen final escrito	(X)
Ejercicios dentro de clase	(X)	Trabajos y tareas fuera del aula	(X)
Ejercicios fuera del aula	( )	Exposición de seminarios por los alumnos	(X)
Seminarios	( )	Participación en clase	( )
Lecturas obligatorias	(X)	Asistencia	(X)
Trabajo de investigación	(X)	Seminarios	(X)
Prácticas de taller o laboratorio	( )	Otras (especificar)	( )
Prácticas de campo	(X)		
Otras (especificar)			
Perfil profesiográfico			
Título o grado	Licenciatura en Administración, Contaduría o áreas afines, Maestría en Administración o Finanzas o experiencia equivalente.		
Experiencia docente	Mínimo tres años en instituciones financieras a nivel mandos medios y directivos. Para profesores de nuevo ingreso, es requisito concluir satisfactoriamente el "Curso Fundamental para Profesores de Nuevo Ingreso (Didáctica Básica)" que imparte la Facultad de Contaduría y Administración.		
Otra característica	Experiencia profesional mínima de tres años en el área de conocimiento. Compartir, respetar y fomentar los valores fundamentales que orientan a la Universidad Nacional Autónoma de México.		
<b>Bibliografía básica:</b>			
Kinnear T., (2000), <i>Investigación de mercados</i> , 5ta edición, México, McGraw-Hill.			
De Alba M., (2000), <i>El mercado de dinero y capitales y el Sistema Financiero Mexicano</i> , México, Pac SA de CV.			

Díaz, A. & Aguilera V., (2012), *Introducción al mercado bursátil*, México, McGraw-Hill.

Fabozzi F., (1997), *Mercados e instituciones financieras*, México, Prentice Hall.

Madura J., (2001), ***Mercados e instituciones financieras***, México, (5ta. Edición), Thomson Learning,

Menchaca M., *Mercado de dinero en México*, México, Trillas.

Mercado E., (2006), *Comercio internacional I*, (5ta edición), México, Limusa Noriega Editores.

Ocampo E., (2013), *Mercado de valores y derecho bursátil México*, (1ra edición), Trillas.

Ramírez S., (2001), ***Moneda, banca y mercados financieros***, México, Prentice Hall.

Soldevilla, E., (1997), *Los fondos de inversión: Gestión y valoración*, España, Pirámide.

**Bibliografía complementaria:**

Díaz M., (2004), *Invierta con Éxito en la Bolsa y Otros Mercados Financieros*, México, Gasca Sicco,

Grupo asesores financieros (1998), *El Mercado Mexicano de Dinero, Capitales y Productos Derivados: Sus Instrumentos y Usos*, Thomson.

Heyman T., (2003), *Inversión en la Globalización*, BMVIMEFITAM

Kolb R., (1994), *Inversiones*, Limusa.

Marmolejo M., (1998), *Inversiones*, Publicaciones IMEF.

Nacional financiera, *Revista el Mercado de Valores*. México

México.Ley del Mercado de Valores, (Vigente)

Ley de Sociedades de Inversión, (Vigente)