



PLAN DE ESTUDIOS (PE): Licenciatura en Actuaría

ÁREA: Finanzas

ASIGNATURA: Administración de Portafolios de Inversión

CÓDIGO:

CRÉDITOS: 6

FECHA: 30 de junio de 2017





1. DATOS GENERALES

Nivel Educativo:	Licenciatura
Nombre del Plan de Estudios:	Licenciatura en Actuaría
Modalidad Académica:	Presencial
Nombre de la Asignatura:	Administración de Portafolio de Inversión
Ubicación:	Nivel Formativo
Correlación:	
Asignaturas Precedentes:	Estrategias de Cobertura de Riesgos
Asignaturas Consecuentes:	Finanzas Bursátiles y Bancarias

>

2. CARGA HORARIA DEL ESTUDIANTE *(Ver matriz 1)*

Concepto	Horas por semana		Total de horas por periodo	Total de créditos por periodo
	Teoría	Práctica		
Horas teoría y práctica (16 horas = 1 crédito)	3	2	100	6





3. REVISIONES Y ACTUALIZACIONES

Autores:	Manuel Ignacio Trujillo Mazorra, José Asunción Hernández, José Raúl Castro Esparza, Ángel Tejeda Moreno, Brenda Zavala López.
Fecha de diseño:	30 de junio de 2017
Fecha de la última actualización:	No aplica
Fecha de aprobación por parte de la academia de área, departamento u otro.	
Revisores:	
Sinopsis de la revisión y/o actualización:	

4. PERFIL DESEABLE DEL PROFESOR (A) PARA IMPARTIR LA ASIGNATURA:

Disciplina profesional:	Actuaría
Nivel académico:	Maestría o Licenciatura con certificación Internacional por la SOA (Sociedad de Actuarios de EUA)
Experiencia docente:	2 años
Experiencia profesional:	1 años

5. PROPÓSITO: El estudiante desarrollara la habilidad de responder la pregunta “¿En qué se debe invertir?” desde un lugar responsable y comprometido. Para ello realizará integralmente un proceso de administración de portafolio de inversión, desde su concepción, hasta su implementación y eventual seguimiento y evaluación.

6. COMPETENCIAS PROFESIONALES:

- Entender de una manera más completa los mercados financieros.
- Conocer el proceso de administración de inversiones y portafolios
- Entender algunas de las teorías de inversiones que se han desarrollado
- Determinar el perfil de riesgo de un inversionista y los objetivos que este pueda tener respecto al manejo de su patrimonio en un portafolio de inversiones.
- Calcular las expectativas de rentabilidad y riesgo de las alternativas de inversión.
- Administrar los riesgos financieros a los que se expone un inversionista.
- Evaluar la obtención de resultados de una estrategia de inversión de portafolios.





- Automatizar mediante Excel VBA la determinación de perfiles de riesgo, la selección y asignación de activos, y el ciclo de retroalimentación de un portafolio.

7. CONTENIDOS TEMÁTICOS

Unidad de Aprendizaje	Contenido Temático	Referencias
1. Introducción a las inversiones	1.1 Configuración de las inversiones 1.2 Proceso de Administración de un Portafolio 1.3 Asignación y Selección de activos 1.4 Índices de Mercados de Valores	1) Reilly, F.; Brown, K. (2015) <i>Analysis of Investments and Management of Portfolios</i> . USA: Cengage Learning.
2. Desarrollos de Teoría de Inversiones	2.1 Mercados Eficientes de Capitales 2.2 Introducción a la Administración de Portafolios 2.3 Introducción a los Modelos de Valuación de Activos 2.4 Modelos multifactoriales de Riesgo-Rendimiento	2) Elton, E.; Gruber, M.; Brown, S.; Goetzmann, W. (2013) <i>Modern Portfolio Theory and Investment Analysis</i> . USA John Wiley & Sons
3. Análisis y administración de acciones	3.1 Macroanálisis y microvaluación del mercado accionario 3.2 Análisis de Industria 3.3 Análisis de las compañías 3.4 Estrategias de Administración de Portafolio de Capitales	3) Elton, E. (2011) <i>Investments and Portfolio Performance</i> . USA: World Scientific
4. Análisis y administración de bonos	4.1 Fundamentos de bonos 4.2 Estrategias de Administración de Portafolios de Bonos	4) Levin, G.; Wyzalek, J. (2014) <i>Portfolio Management</i> . USA: CRC Press.
5. Evaluación de la administración de activos	5.1 Administración profesional de dinero 5.2 Activos alternativos 5.3 Evaluación del desempeño de portafolios	5) Bhat, S. (2008) <i>Security analysis and portfolio management</i> . Nueva Delhi, India: Excel Books. 6) Kevin, S. (2015) <i>Security analysis and portfolio management</i> . Delhi: PHI Learning.

Nota: Las referencias deben ser amplias y actuales (no mayor a cinco años)





8. ESTRATEGIAS, TÉCNICAS Y RECURSOS DIDÁCTICOS *(Enunciada de manera general para aplicarse durante todo el curso)*

Estrategias y técnicas didácticas	Recursos didácticos
<ul style="list-style-type: none"> • Grupos de discusión • Solución de Problemas • Aprendizaje Basado en Problemas • Aprendizaje Basado en Proyectos • Estudio de casos 	<ul style="list-style-type: none"> • Materiales: Plumón, borrador y pizarrón, proyectores, uso de las TICs, notas de clase. • Libro de texto • Bibliografía complementaria. • Listas de ejercicios. • Uso de Paquetería Office y @Risk

9. EJES TRANSVERSALES

Describe cómo se fomenta(n) el eje o los ejes transversales en la asignatura

Eje (s) transversales	Contribución con la asignatura
Formación Humana y Social	Explica de manera clara y precisa las resoluciones de diversos problemas.
Desarrollo de Habilidades en el uso de las Tecnologías de la Información y la Comunicación	Maneja software especializado para la resolución de problemas.
Desarrollo de Habilidades del Pensamiento Complejo	Estructura adecuadamente su pensamiento en la resolución de problemas.
Lengua Extranjera	Es capaz de interpretar el contenido de los textos relacionados en lengua extranjera.
Innovación y Talento Universitario	Entender mejor como conducirse de manera ética en su profesión a fin de cumplir el compromiso que se tiene con la sociedad.
Educación para la Investigación	Investigar e indagar sobre las instituciones del ámbito actuarial nacional e internacional.

10. CRITERIOS DE EVALUACIÓN *(de los siguientes criterios propuestos elegir o agregar los que considere pertinentes utilizar para evaluar la asignatura y eliminar aquellos que no utilice, el total será el 100%)*

Criterios	Porcentaje
▪ Exámenes	80
▪ Participación y Asistencia	5
▪ Tareas	15





Total	100
-------	-----

11. REQUISITOS DE ACREDITACIÓN

Estar inscrito como alumno en la Unidad Académica en la BUAP.
Asistir como mínimo al 80% de las sesiones para tener derecho a exentar por evaluación continua y/o presentar el examen final en ordinario o extraordinario.
Asistir como mínimo al 70% de las sesiones para tener derecho al examen extraordinario.
Cumplir con las actividades académicas y cargas de estudio asignadas que señale el PE.

Notas:

- La entrega del programa de asignatura, con sus respectivas actas de aprobación, deberá realizarse en formato electrónico, vía oficio emitido por la Dirección o Secretaría Académica, a la Dirección General de Educación Superior.
- La planeación didáctica deberá ser entregada a la coordinación de la licenciatura en los tiempos y formas acordados por la Unidad Académica.

