



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



Actinver – UNAM FCA
“Riesgos Financieros en los portafolios”

Clave:	Semestre: 7°	Área o campo de conocimiento: Finanzas			No. Créditos: 8
Carácter: Profesionalizante		Horas		Horas por semana	Horas al semestre
Tipo: Curso		Teoría:	Práctica:	4	64
		4			
Modalidad: Escolarizado		Duración del programa: Semestral			

Seriación indicativa

Asignatura con seriación antecedente: Ninguna

Asignatura con seriación subsecuente: Ninguna

Objetivo general:

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

Índice Temático		
Unidad	Tema	Horas
1	Causas y efectos de la Globalización Económica	12
2	Formación de los mercados financieros en países emergentes	14
3	Importancia y estudio de los Riesgos Financieros	16
4	Riesgos de Mercado	12
5	Riesgos Operativos al crear un portafolio	10
Total de horas:		64

Índice Analítico		
Unidad	Tema	Horas
1	1. Causas y Efectos de la Globalización Económica 1.1 América Latina en el mundo de la Globalización. 1.2 Efectos sociales, políticos en las economías locales 1.3 La importancia de EEUU en la Globalización y sus efectos 1.4 Bloques económicos Brics y G20	12
2	2. Formación de los mercados financieros en países emergentes 2.1 Sistema Financiero Internacional 2.2 Importancia de los mercados financieros globales 2.3 Estructura de los mercados financieros locales 2.4 Inversión extranjera directa	14
3	3. Importancia y estudio de los Riesgos Financieros 3.1 Concepto de Riesgo Financiero 3.2 Proceso de Administración de Riesgos 3.3 Identificación de los riesgos 3.4 Herramientas de evaluación de riesgos	16
4	4. Riesgos de Mercado 4.1 Concepto e importancia 4.2 Factores de riesgo de mercado 4.3 Cuantificación	12
5	5. Riesgos operativos al crear un portafolio de inversión 5.1 Implicaciones al desarrollar una mezcla de inversiones 5.2 Modelo de cuantificación de un riesgo en un portafolio 5.3 Tipos de riesgo que impactan una combinación de activos	10
Total de horas		64

Bibliografía básica:

1. C. KINNEAR, Taylor; R. Taylor James (2000), *Investigación de mercados*, 5ta edición, McGraw-Hill, México
2. DE ALBA, Monroy Arturo (2000), *El mercado de dinero y capitales y el Sistema Financiero Mexicano*, Ed. Pac SA de CV, México
3. DÍAZ Mata, Alfredo; Aguilera Gómez, Víctor (2012), *Introducción al mercado bursátil*, McGraw-Hill, México
4. FABOZZI, Frank (1997), *Mercados e instituciones financieras*. Prentice Hall, México
5. MADURA, Jeff (2001), *Mercados e instituciones financieras*. 5ta. Edición, Thomson Learning, México
6. MENCHACA, Mauricio, *Mercado de dinero en México*, Trillas. México.
7. MERCADO, Ernesto (2006), *Comercio internacional I*, 5ta edición, Limusa Noriega Editores. México.
8. OCAMPO Echazaz, Matias Antonio (2013), *Mercado de valores y derecho bursátil* 1ra edición, Trillas, México.
9. RAMÍREZ Solano, Ernesto (2001), *Moneda, banca y mercados financieros*, Prentice Hall, México
10. Soldevilla García, Emilio (1997), *Los fondos de inversión: Gestión y valoración*, Pirámide, España.

Bibliografía Complementaria:

1. DÍAZ Mondragón, Manuel (2004), *Invierta con Éxito en la Bolsa y Otros Mercados Financieros*, Gasca Sicco, 702 pp. México
2. GRUPO ASESORES FINANCIEROS, *El Mercado Mexicano de Dinero, Capitales y Productos Derivados: Sus Instrumentos y Usos*, Thomson, 1998
3. HEYMAN, Timothy, (2003), *Inversión en la Globalización*, BMVIMEFITAM
4. KOLB, Robert W (1994), *Inversiones*, Limusa, 571 pp.
5. MARMOLEJO G., Martín (1998), *Inversiones*, Publicaciones IMEF.
6. NACIONAL FINANCIERA, *Revista el Mercado de Valores*. México
7. Boletines e información estadística de la Bolsa Mexicana de Valores y de los grupos y Organismos financieros.
8. Ley del Mercado de Valores.
9. Ley de Sociedades de Inversión

Mesografía:

Sugerencias didácticas:

Exposición oral
Exposición audiovisual
Ejercicios dentro de clase

(X)
(X)
(X)

Mecanismos de evaluación del aprendizaje de los alumnos:

Exámenes parciales
Examen final escrito

(X)
(X)

Ejercicios fuera del aula	()	Trabajos y tareas fuera del aula	(X)
Seminarios	()	Exposición de seminarios por los alumnos	()
Lecturas obligatorias	(X)	Participación en clase	(X)
Trabajo de investigación	(X)	Asistencia	(X)
Prácticas de taller o laboratorio	()	Seminario	()
Prácticas de campo	(X)	Otras: _____	()
Otras: _____	()		

Perfil profesiográfico:

Estudios requeridos:

Licenciatura en Administración, Contaduría o áreas afines, Maestría en Administración o Finanzas o experiencia equivalente.

Experiencia profesional deseable:

Mínimo tres años en instituciones financieras a nivel mandos medios y directivos.

Experiencia docente:

Dos años o más a nivel preparatoria o licenciatura.