



UNIVERSIDAD NACIONAL AUTÓNOMA DE MÉXICO
Facultad de Contaduría y Administración
Plan de estudios de la Licenciatura en Administración



Portafolios de Inversión						
Clave 1051	Semestre 8°	Créditos 8	Área de conocimiento	Finanzas		
			Ciclo	Áreas de Desarrollo Temprano		
Modalidad	Curso (X) Taller () Lab () Sem ()			Tipo	T (X) P () T/P ()	
Carácter	Obligatorio ()			Horas		
	Optativo de Elección (X)		Complementario ()	Semana		Semestre
			Profesionalizante (X)	Teóricas		Teóricas
				Prácticas		Prácticas
				Total		Total

Seriación	
Ninguna ()	
Obligatoria ()	
Asignatura antecedente	
Asignatura subsecuente	
Indicativa ()	
Asignatura antecedente	Ninguna
Asignatura subsecuente	Ninguna

Objetivo general: El alumno diseñará, seleccionará, evaluará y administrará carteras de inversión empleando las técnicas y modelos para ello sobre la base de los instrumentos negociados en el mercado de valores.

Objetivos específicos: El alumno:

1. Conocerá la teoría de carteras.
2. Comprenderá la teoría de la elección y las decisiones de inversión.
3. Entenderá el modelo de selección de carteras de Markowitz.
4. Describirá el modelo de índice.
5. Explicará y aplicará el modelo de evaluación de activos financieros.
6. Explicará y aplicará la teoría de la evaluación por arbitraje.
7. Evaluará el desempeño de carteras de inversión

Índice temático			
	Tema	Horas Semestre / Año	
		Teóricas	Prácticas
1	Introducción a la teoría de carteras	8	0
2	La teoría de la elección y las decisiones de inversión	18	0
3	Modelo de selección de carteras de Markowitz	10	0
4	Modelo de índice	2	0
5	Capital asset pricing model	10	0
6	Arbitrage pricing theory	10	0
7	Evaluación del desempeño de carteras	6	0
Total		64	0
Suma total de horas		64	

Estrategias didácticas		Evaluación del aprendizaje	
Exposición	(X)	Exámenes parciales	(X)
Trabajo en equipo	(X)	Examen final	(X)
Lecturas	(X)	Trabajos y tareas	(X)
Trabajo de investigación	(X)	Presentación de tema	()
Prácticas (taller o laboratorio)	(X)	Participación en clase	(X)
Prácticas de campo	()	Asistencia	(X)
Aprendizaje por proyectos	()	Rúbricas	()
Aprendizaje basado en problemas	(X)	Portafolios	()
Casos de enseñanza	(X)	Listas de cotejo	()
Otras (especificar)		Otras (especificar)	
Perfil profesiográfico			
Título o grado	Licenciatura en Administración o afín. Es deseable contar con estudios de posgrado en el área de Finanzas. Conocimientos a nivel de comprensión del idioma inglés y en el manejo de sistemas de cómputo.		
Experiencia docente	Mínima deseable de dos años. 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 dos años en el área de conocimiento y en el Sistema Financiero Mexicano. Compartir, respetar y fomentar los valores fundamentales que orientan a la Universidad Nacional Autónoma de México.		
Bibliografía básica:			
1. Adam, S. J. A. & otros (2004) Análisis Bursátil (2a. ed.), México, Instituto Mexicano de Contadores Públicos.			
2. Bodie, Z., Kane, A. & J. Marcus, A. (2004) Principios de Inversiones (5a. ed.) México, MC-Graw Hiill.			
3. Elton, E. J., Gruber, M. J., Brown, S. & G. W. N. (2006) <i>Modern Portfolio Theory And Investment Analysis</i> , (1era. ed.), USA. Wiley.			

Bibliografía complementaria:

1. Markowitz, H. M. (1992.)Portfolio Selection: Efficient Diversification Of Investments, (1era. ed.), Wiley.
2. Messuti D. J., Alvarez, V. Adrián, Graffi, H. Romano (1992) *Selección De Inversiones: Introducción A La Teoría De Cartera*, (1era. ed.), México, Ediciones Macchi.
3. Reilly, F. K., Brown, Keith C., Reilly, F., (2000) *Investment Analysis And Portfolio Management* (1era. ed.), South-Western Educational, Publishing.
4. Sharpe, W. F. (1999) *Portfolio Theory And Capital Markets*, (1era. ed.), Usa, McGraw-Hill.