



I. INFORMACIÓN GENERAL

CURSO	:	Sistemas de Información Financieros
CÓDIGO	:	BA07
CICLO	:	201602
CUERPO ACADÉMICO	:	Palma Galindo, Fernando Gustavo
CRÉDITOS	:	5
SEMANAS	:	8
HORAS	:	6 H (Teoría) Semanal
ÁREA O CARRERA	:	Banca Epe

II. MISIÓN Y VISIÓN DE LA UPC

Misión: Formar líderes íntegros e innovadores con visión global para que transformen el Perú.

Visión: Ser líder en la educación superior por su excelencia académica y su capacidad de innovación.

III. INTRODUCCIÓN

Curso de especialidad en la carrera de Administración de Banca y Finanzas, de carácter teórico-práctico dirigido a los estudiantes del séptimo ciclo, que busca desarrollar las competencias de Manejo de Información, Gestión Comercial y Gestión Financiera.

Los Sistemas de Información Financiera permiten a los usuarios a explotar una significativa cantidad de datos en forma amigable, en tiempo óptimo, permitiendo en los usuarios su rápida interpretación y toma de acción aprovechando oportunidades o evitando el incurrir en pérdidas. Desde el enfoque tradicional los sistemas de información financiera son el conjunto de elementos cuya función es apoyar las actividades de la empresa o negocio. Su orientación esta sesgada proveer datos referidos a los aspectos financieros, incluyendo los contables y los de variables de mercado.

IV. LOGRO (S) DEL CURSO

Al finalizar el curso, el estudiante analiza la información financiera, bursátil y económica, sobre la base de explotación de Bloomberg con el objetivo de tomar decisiones adecuadas en las diferentes alternativas de inversión financieras.

V. UNIDADES DE APRENDIZAJE

UNIDAD N°: 1 CONCEPTOS BÁSICOS

LOGRO

Al finalizar la primera unidad, el alumno explica la importancia de los sistemas de información gerencial e identifica las principales plataformas que lo soportan a través del conocimiento de las principales herramientas usadas en Bloomberg.

TEMARIO

- Importancia de los Sistemas de Información.
- Tipos de Sistemas de Información.
- Información Financiera Contable.
- Principales sistemas de información financiera.

HORA(S) / SEMANA(S)

Semana 1

UNIDAD N°: 2 CONCEPTOS BASICOS UTILIZANDO ACCIONES**LOGRO**

Al finalizar la segunda unidad, el alumno construye sus propios archivos de monitoreo de información, grafica las variables de su interés y selecciona las variables que planea seguir en el futuro a través del uso de los principales controles del Terminal de Bloomberg.

TEMARIO

- Conceptos de introducción
- Búsqueda de Datos, Noticias
- Vínculos con Excel. Extracción de Datos
- Creación de Gráficos
- Creación de Series y Formulas
- Indicadores Económicos

HORA(S) / SEMANA(S)

Semana 1 y 2

UNIDAD N°: 3 DIVISAS**LOGRO**

Al finalizar la tercera unidad, el estudiante interpreta el mercado global de divisas, obtiene pronósticos de precios de monedas y determina los canales que los afectara a través del conocimiento de los principales indicadores macroeconómicos y canales de transmisión que afectan la política monetaria de las principales economías del mundo.

TEMARIO

- Principales cruces de moneda G10.
- Monedas Emergentes.
- Concepto de Arbitraje.
- Indicadores Macroeconómicos que afectan las monedas
- Posiciones de Monedas por Cruce y tipo de Inversionistas
- Proyecciones de mercado
- Mercado Forward de Monedas.

HORA(S) / SEMANA(S)

Semana 3

UNIDAD N°: 4 TASAS DE INTERES

LOGRO

Al finalizar la cuarta unidad, el estudiante identifica el rendimiento de los activos a nivel local e internacional a través de la comprensión de las principales curvas de tasas de interés del mercado global.

TEMARIO

- Tasas de interés de Bancos Centrales
- Tasas de Interés Local e Internacional (Libor)
- Búsqueda de oportunidades de inversión en el mercado de Renta Fija
- Tasas de Interés como predictor de inflación futura
- Introducción a los Derivados de Tasas de Interés

HORA(S) / SEMANA(S)

Semana 4

UNIDAD N°: 5 COMMODITIES**LOGRO**

Al finalizar la quinta unidad, el estudiante identifica las principales formas de cotizar de commodities en cada mercado por medio del conocimiento de las diferentes herramientas que existen en Bloomberg para estos fines.

TEMARIO

- Búsqueda de Noticias sobre commodities.
- Agricultura.
- Energía
- Metales.
- Derivados de commodities.

HORA(S) / SEMANA(S)

Semana 5

UNIDAD N°: 6 ANÁLISIS TÉCNICO**LOGRO**

finalizar la sexta unidad, el estudiante propone oportunidades de arbitraje de cualquier subyacente a través del conocimiento de las principales herramientas del análisis técnico.

TEMARIO

- Análisis de Tendencias
- Patrones de comportamiento
- Niveles de Soporte y Resistencia
- Osciladores
- Niveles para negociación de muy corto plazo

HORA(S) / SEMANA(S)

Semana 6 y 7

VI. METODOLOGÍA

El desarrollo del curso se resume a continuación:

- Ejercicios de evocación: participación activa de alumnos
- Desarrollo de trabajos de investigación
- Trabajo grupal y exposición de alumnos (grupal)
- Desarrollo de casos
- Las clases debe ser en laboratorio utilizando terminal de Bloomberg. El examen final será en laboratorio (con acceso a Excel).

VII. EVALUACIÓN

FÓRMULA

$$15\% (PC1) + 15\% (PC2) + 15\% (PC3) + 25\% (TF1) + 30\% (EB1)$$

TIPO DE NOTA	PESO %
PC - PRÁCTICAS PC	15
PC - PRÁCTICAS PC	15
PC - PRÁCTICAS PC	15
TF - TRABAJO FINAL	25
EB - EVALUACIÓN FINAL	30

VIII. CRONOGRAMA

Módulo Regular

TIPO DE PRUEBA	DESCRIPCIÓN NOTA	NÚM. DE PRUEBA	FECHA	OBSERVACIÓN	RECUPERABLE
PC	PRÁCTICAS PC	1	Sesión 3	Presencial e individual, con peso de 15%.	SÍ
PC	PRÁCTICAS PC	2	Sesión 7	Presencial e individual, con peso de 15%.	SÍ
PC	PRÁCTICAS PC	3	Sesión 11	Presencial e individual, con peso de 15%.	SÍ
TF	TRABAJO FINAL	1	Sesión 13	Grupal, con peso de 25%.	NO
EB	EVALUACIÓN FINAL	1	Sesión 15	Presencial e individual, con peso de 30%.	SÍ

IX. BIBLIOGRAFÍA DEL CURSO

BÁSICA

YAMARONE, Richard, (2012) The trader's guide to key economic indicators. Hoboken, New Jersey : Wiley.
(330.015195 YAMA)

RECOMENDADA

(No necesariamente disponible en el Centro de Información)

CHOUDHRY, Moorad (2011) Fixed-Income Securities and Derivatives Handbook.,