



## I. INFORMACIÓN GENERAL

<b>CURSO</b>	:	Administración de Portafolios
<b>CÓDIGO</b>	:	FP37
<b>CICLO</b>	:	201802
<b>CUERPO ACADÉMICO</b>	:	<b>Barrera Trujillo, Victor Alfonso</b> <b>Ramos García, Renzo Antonio Elmer</b>
<b>CRÉDITOS</b>	:	5
<b>SEMANAS</b>	:	10
<b>HORAS</b>	:	10 H (Teoría) Semanal
<b>ÁREA O CARRERA</b>	:	Finanzas y Economía 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

Administración de Portafolios, es un curso de especialidad de carácter teórico práctico dirigido a los estudiantes del noveno ciclo de la carrera Administración de Banca y Finanzas, y que desarrolla las competencias generales de "Comunicación Oral " y "Ciudadanía" y la competencia específica "Gestión Financiera".

Su contenido está orientado a que los estudiantes adquieran las habilidades que les permitan realizar una adecuada gestión financiera de los recursos que administren, de manera personal o laboral, para la generación de valor en sus inversiones.

El curso ofrecerá información y herramientas suficientes para estructurar portafolios de inversión y administrarlos adecuadamente.

## IV. LOGRO (S) DEL CURSO

Al finalizar el curso, el estudiante diseña una cartera de inversiones, tomando en cuenta la información del mercado y el conocimiento de los instrumentos que la componen.

## V. UNIDADES DE APRENDIZAJE

<b>UNIDAD N°: 1 La Administración de Portafolios</b>
<b>LOGRO</b> Al finalizar la unidad 1, el estudiante analiza el funcionamiento de los instrumentos que conforman un portafolio de inversiones; a través del cálculo de variables críticas como rentabilidad, riesgo y correlación.

**TEMARIO**

- Rentabilidad y Riesgo de un Activo
- Rentabilidad y Riesgo de una Cartera de Activos
- La Teoría de Portafolios, Revisión
- Rol de la Renta Fija y Renta Variable
- Tipos de Estrategias de Inversión

**HORA(S) / SEMANA(S)**

Semanas 1 - 2

**UNIDAD N°: 2 Administración de Portafolios de Renta Variable****LOGRO**

Al finalizar la unidad 2, el estudiante diseña portafolios de renta variable.

**TEMARIO**

- Introducción a la Renta Variable
- Gestión Pasiva en Renta Variable (Fondos Mutuos, Fondos de Inversión, ETF, Índices)
- Gestión Activa en Renta Variable
- Selección de Valores o Stock Picking
- Análisis Bottom Up y Top Down
- Análisis Fundamental y Análisis Técnico
- Casos

**HORA(S) / SEMANA(S)**

Semanas 3 - 4

**UNIDAD N°: 3 Administración de Portafolios de Renta Fija****LOGRO**

Al finalizar la unidad 3, el estudiante diseña portafolios de renta fija.

**TEMARIO**

- Introducción a la Renta Fija
- Curva de Rendimientos
  - Gestión Pasiva en Renta Fija
  - Gestión Activa en Renta Fija

**HORA(S) / SEMANA(S)**

Semanas 5 - 6

**UNIDAD N°: 4 Inversiones Alternativas y Derivados Financieros****LOGRO**

Al finalizar la unidad 4, el estudiante explica el rol de las inversiones alternativas y el aporte de los derivados financieros en la gestión de inversiones actual.

**TEMARIO**

- Definición de una Inversión Alternativa
- Conceptos Básicos

- Tipos de Inversiones Alternativas
- Definición de un Instrumento Derivado
- Tipos de Instrumentos Derivados
- Operaciones Forward
- Operaciones de Futuros
- Swaps
- Operaciones con Opciones
- Casos

**HORA(S) / SEMANA(S)**

Semanas 7 - 9

**VI. METODOLOGÍA**

El curso se desarrollará en Modalidad Blended, se llevarán a cabo sesiones presenciales y sesiones online aplicando aprendizaje activo.

Las sesiones presenciales serán desarrolladas en el aula, utilizando una metodología dinámica, complementada con la participación activa del estudiante y el desarrollo de casos aplicativos y ejercicios que los alumnos resolverán con el apoyo del docente.

Las evaluaciones correspondientes a las sesiones presenciales serán dos prácticas calificadas individuales escritas, un trabajo final grupal y una evaluación final individual escrita.

En las sesiones online los alumnos estudiarán material multimedia, responderán preguntas de autoevaluación, por medio de las cuales se comprobarán los aprendizajes de los contenidos del curso. El alumno tendrá acceso a materiales audiovisuales, y participará en foros que despejen sus dudas académicas y fortalezcan el aprendizaje colaborativo.

Las evaluaciones correspondientes a las sesiones online serán cuatro evaluaciones virtuales que comprobarán el aprendizaje del alumno fuera de clase, siendo el espíritu, que esté preparado antes de iniciar las sesiones presenciales.

**VII. EVALUACIÓN**

**FÓRMULA**

$$20\% (PC1) + 20\% (PC2) + 15\% (TA1) + 15\% (TF1) + 30\% (EB1)$$

<b>TIPO DE NOTA</b>	<b>PESO %</b>
PC - PRÁCTICAS PC	20
PC - PRÁCTICAS PC	20
TA - TAREAS ACADÉMICAS	15
TF - TRABAJO FINAL	15
EB - EVALUACIÓN FINAL	30

## VIII. CRONOGRAMA

Módulo Regular

TIPO DE PRUEBA	DESCRIPCIÓN NOTA	NÚM. DE PRUEBA	FECHA	OBSERVACIÓN	RECUPERABLE
PC	PRÁCTICAS PC	1	Semana 5	Presencial	SÍ
PC	PRÁCTICAS PC	2	Semana 8	Presencial	SÍ
TA	TAREAS ACADÉMICAS	1	Semana 8		NO
TF	TRABAJO FINAL	1	Semana 9		NO
EB	EVALUACIÓN FINAL	1	Semana 10	Individual	SÍ

## IX. BIBLIOGRAFÍA DEL CURSO

[https://upc.alma.exlibrisgroup.com/leganto/readinglist/lists/3325917050003391?institute=51UPC\\_INST&auth=LOCAL](https://upc.alma.exlibrisgroup.com/leganto/readinglist/lists/3325917050003391?institute=51UPC_INST&auth=LOCAL)