



Universidad Nacional Autónoma de México
Facultad de Contaduría y Administración
Plan de Estudios de la Licenciatura en Contaduría
Programa de la Asignatura



Portafolios de Inversión

Clave:	Semestre: 6° al 8°	Área o campo de conocimiento: Finanzas		No. Créditos: 8
Carácter: Optativa de elección profesionalizante		Horas		Horas al semestre
Tipo: Teórica		Teoría:	Práctica:	Horas por semana 4
		4	0	
Modalidad: Curso		Duración del programa: Semestral		

Seriación: Si () No (X) Obligatoria () indicativa ()

Asignatura con seriación antecedente: Ninguna

Asignatura con seriación subsecuente: Ninguna

Objetivo General:

El alumno será capaz de diseñar, seleccionar, evaluar y administrar carteras de inversión empleando las técnicas y modelos para ello sobre la base de los instrumentos negociados en el mercado de valores.

Índice Temático

Unidad	Tema	Horas	
		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 de horas:		64	0
Suma total de horas:		64	



Bibliografía Básica:

1. ELTON, Edwin J., GRUBER, Martin J., BROWN, Stephen and Goetzmann, William N., *Modern Portfolio Theory and Investment Analysis*, Wiley, 2006, 729 pp.
2. MARKOWITZ, Harry M., *Portfolio Selection: Efficient Diversification of Investments*, Wiley, 1992, 384 pp.
3. MESSUTI, Domingo Jorge, ALVAREZ, Víctor Adrián, GRAFFI, Hugo Romano, *Selección de Inversiones: Introducción a la teoría de cartera*, Ediciones Macchi, Argentina, 1992.
4. REILLY, Frank K., BROWN, Keith C., REILLY, Frank, *Investment Analysis and Portfolio Management*, South-Western Educational Publishing, 2000.
5. SHARPE, William F., *Portfolio Theory and Capital Markets*, McGraw-Hill Trade, 1999.

Bibliografía Complementaria:

1. HULL John C., *Introducción a los Mercados de Futuros y Opciones*, 4ª edición, Ed. Pearson, México, 2002, 560 pp.
2. MERCADO H. Salvador, *Mercado de Dinero y Mercado de Capitales*. Ed. Cengage, México, 2009, 476 pp.
3. RUEDA Arturo, *Para Entender la Bolsa*, 2.ª Edición, Ed. Cengage, México, 2005, 480 pp.

Sugerencias didácticas:		Mecanismos de evaluación del aprendizaje de los alumnos:	
Exposición oral	(x)	Exámenes parciales	(x)
Exposición audiovisual	(x)	Examen final escrito	(x)
Ejercicios dentro de clase	(x)	Trabajos y tareas fuera del aula	(x)
Ejercicios fuera del aula	(x)	Exposición de seminarios por los alumnos	(x)
Seminarios	()	Participación en clase	()
Lecturas obligatorias	()	Asistencia	(x)
Trabajo de investigación	(x)	Seminario	(x)
Prácticas de taller o laboratorio	()		()
Prácticas de campo	()		

Perfil profesiográfico:

Licenciatura en Contaduría o afín con experiencia en el área.
 Deseable contar con estudios de posgrado y con experiencia docente.