



UNIVERSIDAD DE GUADALAJARA
CENTRO UNIVERSITARIO DE
CIENCIAS ECONÓMICO ADMINISTRATIVAS

PROGRAMA DE ASIGNATURA

FORMATO BASE

1.- NOMBRE DE LA MATERIA

INGENIERÍA FINANCIERA I

2.- CLAVE DE LA MATERIA

I5050

3.- PRERREQUISITOS

4.- SERIACIÓN

INGENIERÍA FINANCIERA II

5.- ÁREA DE FORMACIÓN

ESPECIALIZANTE SELECTIVA

6.- DEPARTAMENTO

MÉTODOS CUANTITATIVOS

7.- MODALIDAD DE ASIGNATURA

PRESENCIAL

8.- TIPO DE ASIGNATURA

9.- CARGA HORARIA

Presencial	Trabajo Individual	Total Horas
80	32	112

10.- CRÉDITOS

7

11.- NIVEL DE FORMACIÓN

MAESTRIA

12.- CONTENIDO TEMÁTICO

1. Introducción al Cálculo Estocástico y Cálculo de Itô

2. Mercados Financieros

Mercados Financieros y Mercados de Derivados
Productos Derivados (Historia, Tipos, mercados)
Mexder

3. Contratos Futuros y Forwards

Generalidades
Características y Diferencias
Ventajas y Desventajas
Cámara de Compensación

4. Valuación y arbitraje de Futuros y Forwards

Contratos de divisas (dólar)
Contratos de acciones e índices
Contratos de tasas de interés

5. Coberturas de Futuros y Forwards

Contratos de divisas (dólar)
Contratos de acciones e índices
Contratos de tasas de interés

6. Swaps

Generalidades
Swaps de Tasas de interés
Swaps de Divisas

7. Ecuación de Black y Scholes

Generalidades

8. Opciones

Estrategias
Modelo Binomial
Modelo Black-Scholes
Griegas

9. Opciones Exóticas

17.- BIBLIOGRAFÍA

- Hull, J, "Options, Futures and Derivatives", 6ed. Pearson Prentice Hall, 2007

- Wilmott, "Quantitative Finance", Wiley, 2005
- Sánchez. , "Valor en Riesgo", Algorithmics Mexico, 2001
- Venegas, F., "Riesgos financieros y económicos", Thompson, 2006
- De Lara, A. "Productos Derivados Financieros", Limusa, 2007
- Eiteman, Stonehill & Moffett, Multinational Business Finance, 12th Edition, Pearson – Prentice Hall.

21.- EVALUACIÓN DEL APRENDIZAJE

Entrega de tareas / ejercicios	20%
Trabajo de investigación	20%
Exámenes	40%
Participación en clase	20%
Total	100%

23.- PARTICIPANTES Y FECHA EN LA ELABORACIÓN DEL PROGRAMA

Dr. Guillermo Sierra Juárez
 Dr. Irving Joel Llamosas Rosas
 Dr. J. Jesus Arroyo Alejandro
 Dr. Adrián de León Arias
 Dr. Rafael Salvador Espinosa Ramírez
 Dr. Ruben A. Chavarin Rodríguez
 Dr. Baruch Ramírez Rodríguez

Zapopan, Jalisco 2 de Mayo de 2016