



# UNIVERSIDAD DE GUADALAJARA

## CENTRO UNIVERSITARIO DE CIENCIAS ECONÓMICO ADMINISTRATIVAS

### PROGRAMA DE ASIGNATURA

#### FORMATO BASE

1.- NOMBRE DE LA MATERIA

INGENIERÍA FINANCIERA II

2.- CLAVE DE LA MATERIA

I5051

3.- PRERREQUISITOS

INGENIERÍA FINANCIERA I

4.- SERIACIÓN

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. Modelos de estructura de Plazos de Tasas de Interés
  - a) Tasas de Interés
  - b) Ecuación de Bonos
  - c) Modelos de Tasa Corta
  - d) Modelos de Ajuste
2. Riesgo Financiero
  - a) Riesgo de Mercado
  - b) Riesgo de Crédito
3. Modelos de Portafolio
  - a) Modelos Tradicionales
  - b) Modelo Black\_Litterman

## 13.- BIBLIOGRAFÍA

Hull, J, "Risk Management and Financial Institutions", 2007, Prentice Hall Capitulo 7  
Jorion P, "Valor en Riesgo", 2003, Limusa, Capitulo 1, 2, 3  
Venegas, "Riesgos Financieros y Económicos", 2006, Thomson  
Meucci A., Risk and Asset Allocation, 2007, Springer  
Brown R., Analysis of Investments and Management of Portfolios, ISE

## 14.- EVALUACIÓN DEL APRENDIZAJE

Entrega de tareas / ejercicios (3)	20%
Trabajo de investigación	20%
Exámenes (2)	40%
Participación en clase	20%
<b>Total</b>	<b>100%</b>

## 15.- 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. Chavarín Rodríguez  
Dr. Baruch Ramírez Rodríguez

Zapopan, Jalisco 2 de Mayo de 2016