



## Diseño de Portafolios de Inversión.

### Datos generales

Nombre de la asignatura	Nivel de formación	Clave de la asignatura	
Diseño de Portafolios de Inversión.	Licenciatura	I5709	
Prerrequisito	Area de formación	Departamento	
Administración Financiera	Especializante Selectiva	Departamento de Finanzas	
Academia	Modalidad	Tipo de asignatura	Prerrequisito de % de créditos
Mercados Financieros	Presencial	Curso-Taller	0 %

### Carga horaria

#### Teoría Práctica Total Créditos

40 40 80 8

### Trayectoria de la asignatura

Esta materia se impartirá como especializante selectiva para la licenciatura en Administración Financiera y como optativa para las licenciaturas de Negocios internacionales, Recursos Humanos, Administración de empresas y Mercadotecnia, a partir del cuarto semestre, habiendo tomado previamente la materia de Administración Financiera.

### Contenido del programa

#### Presentación

La materia de Diseño de portafolios de inversión está dirigida a estudiantes de las carreras de Lic. en Administración Financiera, su importancia en el plan de estudios radica en que son materias de formación especializante selectiva, además su aplicación en el mercado es relevante debido a que en cualquier empresa se hace necesario tomar decisiones sobre inversiones.

#### Objetivos del programa

##### Objetivo general

Distinguir el funcionamiento, importancia y diferencias de los mercados financieros (mercado de divisas, mercado de capitales, mercado de dinero, mercado de derivados) a nivel nacional estudiando los activos financieros que en ellos se negocian, su valoración y sus riesgos, con una visión de responsabilidad social, sustentable y sostenible.

### Contenido

#### Contenido temático

HERRERA

Unidad II. Teoría del Portafolio

Unidad III. Beneficios de los portafolios de inversión internacionales.

Unidad IV. Diseños de portafolios de inversión.

Contenido temático

## Unidad I. Análisis del riesgo y rendimiento.

Objetivo ~~para~~ ~~ejemplificar~~ el análisis del riesgo y el rendimiento mediante técnicas estadísticas seleccionar los instrumentos de inversión para integrar portafolios.

- 1.1 Conceptos fundamentales de riesgo y rendimiento.
- 1.2 Significado y medición de riesgo
- 1.3 Relación entre riesgo y rendimiento
  - 1.3.1 Tasa libre de riesgo
  - 1.3.2 Prima de riesgo
  - 1.3.3 Riesgo del negocio y riesgo financiero
  - 1.3.4 Riesgo sistemático y no sistemático
  - 1.3.5 Riesgo y rendimiento requerido de diversos tipos de valores
- 1.4 Diversificación de inversiones y análisis del riesgo de una cartera
- 1.5 El riesgo de una cartera y el modelo de valuación de activos
- 1.6 Modelo de valuación de activos de capital
- 1.7 CAPM multifactorial
- 1.8 Modelo de la teoría de arbitraje de precios.

## Unidad II. Teoría del Portafolio

Objetivo ~~para~~ ~~explicar~~ la teoría de portafolios de inversión para identificar los mejores instrumentos financieros para integrar el portafolio.

- 2.1 Conceptos fundamentales de portafolios de inversión.
- 2.2 Rendimiento esperado de un portafolio
- 2.3 Delineación de portafolios eficientes.
- 2.4 La frontera eficiente sin ventas en corto
- 2.5 La frontera eficiente con ventas en corto
- 2.6 La frontera eficiente con inversiones y préstamos a la tasa libre de riesgo
- 2.7 Técnicas para la determinación de la frontera eficiente.
- 2.8 El modelo con un solo índice.

## Unidad III. Beneficios de los portafolios de inversión internac

Objetivo ~~para~~ ~~identificar~~ los beneficios que se obtienen de los portafolios de inversión internacionales para

Hoops

3.1 Diversificación de riesgos correlacionados entre los mercados de activos nacionales.

3.2 Valuación de activos de capital a nivel internacional.

3.3 Diversificación de bonos y de portafolios internacionales.

3.4 Liquidación de portafolios internacionales de inversión.

#### Actividades prácticas

Diseñar Portafolios de Inversión a partir del análisis del riesgo y rendimiento de activos financieros nacionales e internacionales. Asistencia a los Congresos internacionales de Contaduría Pública y de Administración. Se promoverán visitas guiadas a empresas (una por semestre) Participar en el Torneo Forex organizado por el Depto. De Finanzas.

#### Metodología

*Lectura previa* del tema a tratar, con el propósito de tener un control de lectura de los alumnos, el cual se evidenciará mediante un resumen o cuestionario contestado. Todo ello para fomentar la lectura con los alumnos, lo que les ayuda indudablemente a indagar sobre los temas y ampliar su conocimiento. Exposición del profesor. Es importante una *comunicación efectiva* de parte del profesor mediante la cual transmita un conjunto de conocimientos que ayude a los alumnos a obtener aprendizajes significativos a través de métodos y estrategias apropiadas, para facilitar la comprensión, el desarrollo de habilidades, destrezas y actitudes favorables ante las situaciones diversas que motive a los estudiantes a reflexionar sobre su propio aprendizaje. Casos prácticos de análisis de riesgo y rendimiento de activos individuales y de portafolios. (ABP). Casos prácticos de Diseños de portafolios (ABP). Tareas: individuales y en equipo. Trabajo de investigación basado en método del caso (en equipo).

#### Evaluación

La evaluación será continua, tomando en cuenta todas las actividades de aprendizaje (curriculares y extracurriculares) y se considerarán los siguientes criterios de evaluación:

Tareas y control de lectura previa.	10 %
Participación en la clase.	5 %
Examen departamental.	20 %
Exámenes parciales.	20 %
Trabajo de investigación en el que se evaluarán los siguientes elementos:	35 %
a) El contenido del trabajo	
b) Expresión oral y escrita	
c) Uso de las TIC's	
d) Aplicación de Metodología de la investigación	
<b>TOTAL</b>	<b>100%</b>

#### Bibliografías

#### Bibliografía

#### Libro

Fundamentos de Finanzas Corporativas

Flora  
Suárez

ISBN: 978-1456260910

Libro

Finanzas Corporativas un enfoque Latinoamericano

Michael C Ehrhardt y Brigham E (2017) Cengage Learning No. Ed 1A

ISBN: 978-6075264196

Libro

Planeación Financiera Integral

Corona Dueñas José Asunción (2017) AM Editores No. Ed 1a

ISBN: 9786074374209

Libro

Finanzas I: Contabilidad Planeación y Administración

Núñez Alvarez Luis (2016) IMCP No. Ed 1a.

ISBN: 9786078463343

Libro

Proyectos de Inversión Para PYME

Flores Uribe Juan Antonio (2018) Ecoe Ediciones No. Ed 3a.

ISBN: 9789587710809

Otros materiales

-

---

Perfil del profesor

Ser Contador Público titulado, Contador Público, Contador Público y Auditor, Licenciado en Administración de Empresas con perfil en Finanzas, Lic., y En Admón Financiera. Experiencia profesional indispensable. Cuando menos de 3 años en el área financiera.

---

Lugar y fecha de su aprobación

Zapopan, Jalisco 15 de julio de 2025

---

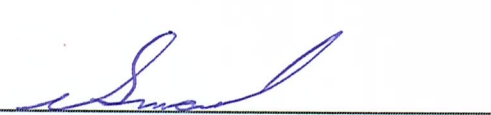
Instancias que aprobaron el programa

Colegio Departamental

Unidad Académica de Finanzas

Hoozo  
Hoozo

---



---

