

# SÍLABO

## Banca de Inversión

<b>Código</b>	ASUC01624	<b>Carácter</b>	Electivo	
<b>Prerrequisito</b>	140 créditos aprobados			
<b>Créditos</b>	3			
<b>Horas</b>	<b>Teóricas</b>	2	<b>Prácticas</b>	2
<b>Año académico</b>	2025			

### I. Introducción

---

La asignatura corresponde al área de estudios específicos, es de naturaleza teórico-práctica. La asignatura desarrolla, en un nivel logrado, la competencia Gestión Financiera. En virtud de lo anterior, su relevancia reside en desarrollar en el estudiante la capacidad de comprender la instrumentación del sistema bancario y las inversiones que generan estas instituciones para realizar inversiones.

Los contenidos generales que la asignatura desarrolla son los siguientes: mercado financiero, mercado monetario bancario y no bancario (instrumentos financieros), títulos de mediano y largo plazo, arrendamiento financiero, mercados futuros y derivados; apalancamiento operativo, financiero y total; administración de activos a corto y largo plazo en entorno global; proyecciones financieras, medición de la rentabilidad y proyecciones.

---

### II. Resultado de aprendizaje de la asignatura

---

Al finalizar la asignatura, el estudiante será capaz de determinar los instrumentos financieros que ayuden a las empresas a realizar inversiones, tomando en consideración el riesgo y la facilidad de acceso.

---

**III. Organización de los aprendizajes**

<b>Unidad 1 Mercados financieros</b>		<b>Duración en horas</b>	<b>16</b>
<b>Resultado de aprendizaje de la unidad</b>	Al finalizar la Unidad, el estudiante será capaz de analizar el comportamiento del mercado financiero en un contexto empresarial.		
<b>Ejes temáticos</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Mercado financiero</li> <li>2. Mercado monetario bancario y no bancario</li> <li>3. Entorno económico</li> <li>4. Las <i>Fintech</i> y la banca</li> </ol>		

<b>Unidad 2 Títulos e instrumentos financieros</b>		<b>Duración en horas</b>	<b>16</b>
<b>Resultado de aprendizaje de la unidad</b>	Al finalizar la Unidad, el estudiante será capaz de analizar los instrumentos de inversión y financiamiento en un contexto empresarial.		
<b>Ejes temáticos</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Títulos de mediano y largo plazo</li> <li>2. Mercado de derivados: futuros, opciones, <i>forward</i> y <i>swaps</i></li> <li>3. El <i>blockchain</i> y las criptomonedas</li> </ol>		

<b>Unidad 3 Estructura financiera y operativa</b>		<b>Duración en horas</b>	<b>16</b>
<b>Resultado de aprendizaje de la unidad</b>	Al finalizar la Unidad, el estudiante será capaz de proponer una estructura financiera y operativa considerando el entorno global.		
<b>Ejes temáticos</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Apalancamiento operativo</li> <li>2. Apalancamiento financiero y total</li> <li>3. Administración de activos a corto plazo</li> <li>4. Administración de activos a largo plazo</li> </ol>		

<b>Unidad 4 Proyección Financiera</b>		<b>Duración en horas</b>	<b>16</b>
<b>Resultado de aprendizaje de la unidad</b>	Al finalizar la Unidad, el estudiante será capaz de determinar la aplicación de la proyección financiera, considerando el riesgo y la rentabilidad.		
<b>Ejes temáticos</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Proyección financiera</li> <li>2. Medición de la rentabilidad</li> <li>3. Proyección de flujos</li> </ol>		

#### IV. Metodología

##### Modalidad Presencial

- Aprendizaje colaborativo
- Aprendizaje experiencial
- Estudio de casos
- Aprendizaje basado en problemas

#### V. Evaluación

##### Modalidad Presencial

Rubros	Unidad por evaluar	Fecha	Entregable / Instrumento	Peso parcial	Peso total
Evaluación de entrada	Prerrequisito	Primera sesión	- Evaluación individual teórica / <b>Prueba objetiva</b>	<b>0 %</b>	
Consolidado 1 <b>C1</b>	1	Semana 1 - 4	- Exposición grupal: mercados financieros en el entorno económico actual / <b>Rúbrica de evaluación</b>	50 %	<b>20 %</b>
	2	Semana 5 - 7	- Trabajo individual: análisis de instrumentos financieros en un caso propuesto / <b>Rúbrica de evaluación</b>	50 %	
Evaluación parcial <b>EP</b>	1 y 2	Semana 8	- Trabajo práctico individual: análisis de instrumentos financieros considerando el entorno global en un caso planteado / <b>Rúbrica de evaluación</b>	<b>25 %</b>	
Consolidado 2 <b>C2</b>	3	Semana 9 - 12	- Exposición grupal: planteamiento de la estructura financiera en un caso propuesto / <b>Rúbrica de evaluación</b>	50 %	<b>20 %</b>
	4	Semana 13 - 15	- Trabajo individual: aplicación de la proyección financiera en un caso propuesto / <b>Rúbrica de evaluación</b>	50 %	
Evaluación final <b>EF</b>	Todas las unidades	Semana 16	- Exposición grupal: proyecto integrador de las cuatro unidades en un caso propuesto / <b>Rúbrica de evaluación</b>	<b>35 %</b>	
Evaluación sustitutoria*	Todas las unidades	Fecha posterior a la evaluación final	- <b>Aplica</b>		

\* Reemplaza la nota más baja obtenida en los rubros anteriores.

#### Fórmula para obtener el promedio:

$$PF = C1 (20\%) + EP (25\%) + C2 (20\%) + EF (35\%)$$

## VI. Bibliografía

### Básica

Revello, J. (Coord.). (2013). *Manual de corporate finance y banca de inversión*. Delta Publicaciones. <https://asms.short.gy/bWqX1I>

### Complementaria

Madura, J. (2016). *Mercados e instituciones financieras* (11.ª ed.). Cengage Learning. <https://bit.ly/3NDPZVL>

## VII. Recursos digitales

Bolsa de Valores de Lima. (s.f.). *Negociación diaria*. Recuperado el 9 de junio de 2022 de <https://www.bvl.com.pe/mercado/movimientos-diarios>

Martín, M. (2010). *Mercado de capitales: una perspectiva global*. Cengage Learning. <https://bit.ly/3dMarEU>

Superintendencia de Banca, Seguros y AFP. (s.f.). *Portal SBS*. Recuperado el 9 de junio de 2022 de <https://www.sbs.gob.pe/>

Superintendencia de Mercado de Valores. (s.f.). *Portal SMV*. Recuperado el 9 de junio de 2022 de <https://www.smv.gob.pe/Default.aspx>

Yahoo. (s.f.). *Portal Yahoo Finance*. Recuperado el 9 de junio de 2022 de <https://finance.yahoo.com/>