

SÍLABO

Instrumentos y Mercados Financieros

Código	ASUC01370	Carácter	Obligatorio	
Prerrequisito	80 créditos aprobados			
Créditos	4			
Horas	Teóricas	2	Prácticas	4
Año académico	2024			

I. Introducción

Instrumentos y Mercados Financieros es una asignatura de especialidad de carácter obligatorio, se ubica en el sexto periodo de la Escuela Académico Profesional de Administración y Finanzas. Tiene como prerrequisito haber aprobado 80 créditos y es prerrequisito de Planificación Financiera, Mercado de Capitales y Banca.

La asignatura desarrolla, en un nivel intermedio, la competencia transversal Administración de Operaciones y TI y la competencia específica Gestión de Instituciones Financieras. En virtud de lo anterior, la relevancia de la asignatura reside en la formulación de objetivos y el diseño de estrategias de gestión con visión global, basados en la ética y la responsabilidad social; en el análisis y el diseño de estrategias de captación y colocaciones de activos en las instituciones financieras evaluando el impacto en el riesgo y la rentabilidad.

Los contenidos que la asignatura desarrolla son los siguientes: Mercados financieros e instituciones financieras, tipos de mercado financieros, rol de los mercados financieros, estructuras de las tasas de interés.

II. Resultado de aprendizaje de la asignatura

Al finalizar la asignatura, el estudiante será capaz de aplicar métodos cuantitativos y tecnologías de información en la administración de operaciones, utilizar TI y simuladores para la toma de decisiones organizacionales, formular estrategias de captación y colocación de activos en las instituciones financieras y estrategias para evaluar el impacto del riesgo y la rentabilidad de productos financieros.

III. Organización de los aprendizajes

Unidad 1 Mercados e instituciones financieras		Duración en horas	24
Resultado de aprendizaje de la unidad	Al finalizar la unidad, el estudiante será capaz de describir la función de los mercados financieros e identificar los tipos de instrumentos e instituciones que facilitan las transacciones en los mercados financieros.		
Ejes temáticos	<ol style="list-style-type: none"> 1. Panorama general 2. Función de los mercados financieros 3. Regulación y política monetaria 4. Instituciones e instrumentos financieros 		

Unidad 2 Estructura de tasas y mercado de deuda		Duración en horas	24
Resultado de aprendizaje de la unidad	Al finalizar la unidad, el estudiante será capaz de explicar la estimación del rendimiento apropiado de cualquier valor de deuda, la manera del uso del mercado de dinero y de bonos por los inversionistas, así como identificar los factores que afectan los precios de los mismos.		
Ejes temáticos	<ol style="list-style-type: none"> 1. Determinación de las tasas de interés 2. Mercado de dinero 3. Mercado de bonos 		

Unidad 3 Mercado de capitales		Duración en horas	24
Resultado de aprendizaje de la unidad	Al finalizar la unidad, el estudiante será capaz de explicar cómo facilitan los mercados de capitales las transacciones del mercado secundario, de describir el proceso de ofertas accionarias y cómo se realizan las transacciones bursátiles.		
Ejes temáticos	<ol style="list-style-type: none"> 1. Mercado de renta variable 2. Ofertas accionarias 3. Valuación y riesgo de las acciones 4. Estrategias de mercado 		

Unidad 4 Mercado de derivados		Duración en horas	24
Resultado de aprendizaje de la unidad	Al finalizar la unidad, el estudiante será capaz de aplicar los instrumentos financieros tomando en cuenta los factores que afectan el riesgo y la rentabilidad desde la postura del inversionista en el marco de una estrategia global de mercado.		
Ejes temáticos	<ol style="list-style-type: none"> 1. Futuros y opciones 2. Forward y swaps 3. Mercados financieros globales 		

IV. Metodología

Modalidad Presencial

La asignatura se desarrollará siguiendo la secuencia teórica-práctica, para ello se aplicará la metodología experiencial y colaborativa, mediante exposiciones; asimismo, se promoverá el debate, el estudio de casos y el aprendizaje basado en problemas con el uso de herramientas de información.

El estudiante hará uso del material de trabajo para la realización de los casos prácticos. Se propiciará la investigación bibliográfica e investigación vía Internet. Los recursos y materiales a utilizar son los siguientes: el aula virtual, laboratorio de cómputo, acceso a páginas especializadas y el soporte de la información a través de la plataforma de Bloomberg.

V. Evaluación

Modalidad Presencial

Rubros	Unidad por evaluar	Fecha	Entregable / Instrumento	Peso parcial	Peso total
Evaluación de entrada	Prerrequisito	Primera sesión	Evaluación escrita teórica / Prueba objetiva	0 %	
Consolidado 1 C1	1	Semana 1 - 4	Exposiciones grupales / Rúbrica de evaluación	50 %	20 %
	2	Semana 5 - 7	Ejercicios grupales de análisis de casos desarrollados en clase / Rúbrica de evaluación	50 %	
Evaluación parcial EP	1 y 2	Semana 8	Ejercicios individuales de análisis de casos / Rúbrica de evaluación	25 %	
Consolidado 2 C2	3	Semana 9 - 12	Ejercicios grupales de análisis de casos desarrollados en clase / Rúbrica de evaluación	50 %	20 %
	4	Semana 13 -15	Ejercicios grupales de análisis de casos desarrollados en clase / Rúbrica de evaluación	50 %	
Evaluación final EF	Todas las unidades	Semana 16	Exposiciones grupales / Rúbrica de evaluación	35 %	
Evaluación sustitutoria			Aplica		

Fórmula para obtener el promedio

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

VI. Bibliografía**Básica**

Madura, J. (2016). *Mercados e instituciones financieras*. (11.ª ed.). Cengage Learning.
<https://bit.ly/3RXU75X>

Complementaria

Martín, J., y Téllez, C. (2014). *Finanzas internacionales*. (2.ª ed.). Paraninfo.

Martín, M. (2010). *Mercado de capitales: una perspectiva global*. Cengage Learning.

VII. Recursos digitales

Bolsa de Valores de Lima (BVL). (2020). <https://www.bvl.com.pe/>

Superintendencia de Banca, Seguros y AFP (SBS). (2020). <https://www.sbs.gob.pe/>

Superintendencia del Mercado de Valores (SMV). (2020). <https://www.smv.gob.pe/>