



SÍLABO 2017-2

FACULTAD DE CIENCIAS EMPRESARIALES Y ECONÓMICAS
CARRERA DE ECONOMÍA
CARRERA DE ADMINISTRACIÓN

ASIGNATURA	HERRAMIENTAS INFORMÁTICAS PARA LAS FINANZAS
ÁREA	MERCADO DE CAPITAL
CÓDIGO	3276
NIVEL	NOVENO
CARÁCTER	ELECTIVO
REQUISITOS	MERCADO DE CAPITAL
CRÉDITOS	TRES (3)
HORAS DE TEORÍA	TRES (3)
HORAS DE PRÁCTICA	CERO(0)
PROFESOR (ES)	BELLIDO/ANICAMA/ALFREDO BRUNO ®

I. SUMILLA

La asignatura corresponde al área de especialidad de finanzas y mercado de capitales que se desarrollará mediante el modelo teórico-práctico. La asignatura brindará al alumno el aprendizaje del uso y manejo de las herramientas financieras Economática, Thomson Reuters Eikon, Bloomberg, Datastream y Risk simulator con lo cual contará con las herramientas especializadas de uso actual en el mercado laboral que puedan permitirle desarrollar sus capacidades y habilidades de forma competitiva.

La asignatura ofrecerá mediante casos prácticos y de actualidad económica el aprendizaje de estas herramientas de información y de análisis que permitan al alumno tener mayores alternativas para la toma de decisiones de inversión.

II. OBJETIVOS GENERALES

Aplicar las herramientas especializadas de información y análisis de uso en el mercado laboral que puedan permitirle desarrollar sus capacidades y habilidades de forma competitiva.

III. OBJETIVOS ESPECÍFICOS

1. Manejar las herramientas especializadas de información y análisis: Economática, Thomson Reuters Eikon, Bloomberg, Datastream y Risk Simulator.
2. Desarrollar la aplicabilidad de las herramientas de información y análisis mediante casos prácticos.
3. **Obtener la certificación Bloomberg.**
4. Obtener la certificación de Thomson Reuters.

IV. PROGRAMA ANALÍTICO

PRIMERA SEMANA

Economática:

Manejo de las herramientas básicas, múltiplos y base de datos.

Preparar un portafolio de acciones de los países latinoamericanos y del mercado bursátil de Estados Unidos usando los indicadores financieros, indicadores técnicos e indicadores de mercado.

SEGUNDA SEMANA

Economática:

Crear plantillas que permitan visualizar un portafolio de acciones, el análisis técnico, las noticias y los derechos de los activos relacionados a los activos financieros del portafolio.

Mediante el uso de la herramienta avanzada se determinará la optimización de un portafolio en Economática que permita determinar la frontera eficiente considerando las correlaciones y restricciones correspondientes.

Bloomberg:

Red global de información financiera, inteligencia de negocios y personas.

Introducción y manejo de la base de datos.

Helpful Keys. Código Nemónico de los activos.

Análisis Económico. Data Económica y proyecciones Económicas.

TERCERA SEMANA

Bloomberg:

Información y análisis en particular sobre los mercados financieros, sobre un valor específico, sobre activos financieros y variables macroeconómicas

Estudio, análisis y proyecciones de las materias primas (Commodities).

Casos sobre el Mercado Integrado Latinoamericano (MILA) y el Mercado Global

Risk Simulator:

Introducción al Risk Simulator. Variables supuestas, variables pronóstico y simulación Montecarlo. Distribución de probabilidad normal, uniforme, triangular y pert.

Casos aplicativos. Creación de la plantilla informativa para el análisis y control de un portafolio.

CUARTA SEMANA

Bloomberg:

Renta Variable. Parte I

Creación de un portafolio de acciones y un análisis de riesgos. Análisis de los estados financieros, múltiplos, beneficios, dividendos, y valuación relativa de los activos.

Peer Comparison. Precio de las acciones, análisis fundamental, valuación de la compañía, recomendación de analistas, estimaciones, análisis de la industria.

Risk Simulator:

Casos aplicativos: Optimización de un portafolio

QUINTA SEMANA

Bloomberg:

Práctica Indicadores Económicos. Módulo BMC Economic Indicators.

Risk Simulator:

Casos aplicativos: análisis del flujo de caja, análisis tornado y análisis de sensibilidad.

SEXTA SEMANA

Bloomberg:

Módulo de Renta Variable. Parte II

Análisis Técnico y aplicaciones en Excel. Explicar tendencias, soporte, resistencia, RSI, MACD y Medias móviles.

Aplicación Launchpad.

Exámenes Módulo BMC Equity.

SÉPTIMA SEMANA

Bloomberg:

Investigación y navegación de datos, API

Exámenes Módulo BMC Equity.

Risk Simulator:

Casos aplicativos: Evaluación del VAR y Spline Cubic,

OCTAVA SEMANA

**Evaluación del proceso de aprendizaje.
Revisión académica de contenidos.**

NOVENA SEMANA

Bloomberg:

Commodity Hedging.

Currencies

Definición, mercado forex y capitalización bursátil.

Determinantes en los cambios de valor de las monedas.

Simulación Bolsa de Valores

DÉCIMA SEMANA

Bloomberg:

Currencies

Funciones del Banco Central: Control de la inflación

Diferencia entre inflación y deflación

Riesgo cambiario

Thomson Reuters Eikon:

Introducción. Funcionalidades Básicas. Motores de Búsqueda. Manejo de las Apps.

Información de un activo financiero e índices bursátiles: Quote, Quote list, análisis técnico, noticias, propuestas de compra y propuesta de venta de las acciones

UNDÉCIMA SEMANA

Thomson Reuters Eikon:

Creación de Plantillas (templates)

Información de variables macroeconómicas local, regional y global.

Utilización del Eikon y vínculos a Excel.

Casos aplicativos.

DUODÉCIMA SEMANA

Bloomberg:

Práctica Divisas. Módulo BMC Currencies.

Risk Simulator:

Caso aplicativo

DECIMOTERCERA SEMANA

Thomson Reuters Eikon:

Análisis de Acciones, Bonos, Monedas y Commodities.
Portafolios.

Bloomberg:

Fixed Income. Gasto del gobierno financiado a través de bonos. Manejo de expectativas de tasas de interés por parte de bancos centrales y su influencia en el yield de los bonos a través de sus tasas de interés.

DECIMOCUARTA SEMANA

Thomson Reuters Eikon:

Mercado de Derivados. Futuros y Forwards. Opciones. Swap.
Datastream.
Herramientas alternativas de inversión en el mercado internacional

Bloomberg:

Curva rendimiento de los bonos soberanos.
Los Bonos de Estados Unidos como activos de refugio.
Análisis de bonos.

Risk Simulator:

Caso aplicativo

DECIMOQUINTA SEMANA

Thomson Reuters Eikon:

Bonos Soberanos. Bonos corporativos. Índice de Bonos. Curvas de Rendimiento
Casos aplicativos

Bloomberg:

Exámenes Módulo BMC Fixed Income.

DECIMOSEXTA SEMANA

**Evaluación del proceso de aprendizaje.
Revisión académica de contenidos.**

V. METODOLOGÍA

Las clases consistirán principalmente en la solución de casos prácticos con el uso del software mencionado, para los cuales se contará con la asistencia del profesor.

VI. SISTEMA DE EVALUACIÓN

El sistema de evaluación del Reglamento General de estudios contempla la siguiente ponderación de notas.

- Examen Parcial: Peso 3
- Tarea Académica: Peso 3
- Examen Final: Peso 4

En lo referente a Tarea Académica, la nota saldrá de un promedio de las prácticas calificadas y trabajos de aplicación, en base a las siguientes ponderaciones:

Tipo de Evaluación	No. de Evaluaciones	Pesos
Prácticas	2	50%
Trabajos: Resolución de casos y problemas	2	50%

No existe rezagado de prácticas calificadas, ni de evaluación alguna comprendida en la tarea académica.

Art. 41RGE. El alumno que al final del período académico excede el límite de inasistencias sobre el total de horas de clase programadas, esta impedido de rendir examen final. Queda exceptuado el alumno matriculado con cruce de horarios, según lo previsto en el artículo 22º.

El límite de inasistencias se establece por el nivel de la asignatura del plan de estudios de su carrera. Del primero al quinto nivel es de 21%; y del sexto hasta la finalización de la carrera es de 32%.

El profesor de la asignatura es responsable de la aplicación de esta norma.

VII. BIBLIOGRAFÍA

OBLIGATORIA

Libros:

Roos, S, Westerfield, R., & Jaffe, J. (2012). **Finanzas Corporativas** (9ª. ed.) México: Mc Graw Hill.

Alexander, G., Sharpe, W., & Bailey, J (2003). **Fundamentos de Teoría y práctica.** (3ª Ed). México: Pearson Educación.

Gitman, Lawrence J. (2009). **Fundamentos de inversiones** (10ª ed.). México: Pearson Education.

COMPLEMENTARIA

Manuales de Usuario:

<http://www.economatica.com>

<http://www.thomsonreuters.com>

<http://www.bloomberg.com>

<http://www.risksimulator.com>

<http://www.realoptionsvaluation.com/risksimulator.html>

Información acerca de los mercados de valores. Simulador bursátil.

<http://www.investopedia.com>

[http://fresno.ulima.edu.pe/sf/sf_bd5300.nsf/otrosweb/pulsobursatil/\\$file/pulsobursatil.pdf](http://fresno.ulima.edu.pe/sf/sf_bd5300.nsf/otrosweb/pulsobursatil/$file/pulsobursatil.pdf)

[http://fresno.ulima.edu.pe/sf/sf_bd5300.nsf/otrosweb/pulsobursatil/\\$file/pulsobursatil_en.pdf](http://fresno.ulima.edu.pe/sf/sf_bd5300.nsf/otrosweb/pulsobursatil/$file/pulsobursatil_en.pdf)

[http://fresno.ulima.edu.pe/sf/sf_bd5300.nsf/OtrosWeb/PULSOSEMANAL/\\$file/reporte.pdf](http://fresno.ulima.edu.pe/sf/sf_bd5300.nsf/OtrosWeb/PULSOSEMANAL/$file/reporte.pdf)

[http://fresno.ulima.edu.pe/sf/sf_bd5300.nsf/otrosweb/pulsoeconomico/\\$file/PULSO-ECONOMICO.pdf](http://fresno.ulima.edu.pe/sf/sf_bd5300.nsf/otrosweb/pulsoeconomico/$file/PULSO-ECONOMICO.pdf)

DIRECCIONES ELECTRÓNICAS DE INSTITUCIONES RELACIONADAS AL MERCADO FINANCIERO Y DE CAPITALES

Superintendencia de Banca y Seguros: www.sbs.gob.pe

Superintendencia de Mercado de Valores: www.smv.gob.pe

Bolsa de valores de Lima www.bvl.com.pe

Banco Central de Reserva del Perú: www.bcrp.gob.pe

Fondo Monetario Internacional: www.imf.org