ATMIRE

Title	CFA Workshop - AF124 - 202302
Item Type	info:eu-repo/semantics/report
Authors	Gómez Sánchez Arbulú, Alvaro Martin
Publisher	Universidad Peruana de Ciencias Aplicadas (UPC)
Rights	info:eu-repo/semantics/openAccess
Download date	2026-11-28 11:32:42
Link to Item	http://hdl.handle.net/10757/676514

I. INFORMACIÓN GENERAL

CURSO	:	CFA Workshop
CÓDIGO	:	AF124
CICLO	:	202302
CUERPO ACADÉMICO	:	**Gómez Sánchez Arbulú, Alvaro Martin**
CRÉDITOS	:	4
SEMANAS	:	16
HORAS	:	4 H (Práctica) Semanal /2 H (Teoría) Semanal
ÁREA O CARRERA	:	Administracion y Finanzas

II. MISIÓN Y VISIÓN DE LA UPC

Misión: Formar líderes íntegros e innovadores con visión global para que transformen el Perú.

Visión: Ser líder en la educación superior por su excelencia académica y su capacidad de innovación.

III. INTRODUCCIÓN

CFA Workshop es un curso de especialidad de la carrera de Administración y Finanzas de carácter teórico-práctico dirigido a los estudiantes de décimo ciclo.

En al ámbito financiero internacional, contar con la mención Chartered Financial Analyst (CFA) es un sinónimo de excelencia académica y profesional. Inversionistas y empleadores en todo el mundo utilizan esta certificación como un estándar para medir la integridad y competencia en las áreas de análisis de inversiones y administración de portafolios.
La designación CFA requiere que sus candidatos demuestren un conocimiento estricto del currículo, que abarca diferentes campos relacionados con las finanzas y las inversiones. Esta certificación se otorga a los candidatos después de aprobar los exámenes correspondientes a los niveles I, II y III y demostrar una destacada experiencia laboral. Los tres niveles del examen CFA son ofrecidos en Junio de cada ano en más de 150 ciudades alrededor del mundo, entre ellas Lima. En el Perú, la Superintendencia de Banca y Seguros (SBS) publicó en el 2005 un marco normativo para asegurar un manejo más eficiente y profesional de los recursos que administran las entidades financieras, las compañías de seguros y las administradoras de fondos de pensiones (AFP).

El curso "CFA Workshop" pretende exponer en forma útil y práctica los conceptos, criterios y herramientas de análisis y gestión de inversiones que le permitan al candidato al examen CFA Nivel I desarrollar las habilidades y estrategias necesarias para su práctica profesional y el logro con éxito de la certificación de analista financiero.

IV. LOGRO (S) DEL CURSO

Al finalizar el estudiante desarrolla las estrategias necesarias para completar el examen CFA Nivel I satisfactoriamente.

El curso desarrolla las siguientes competencias:
Competencia Específica: Toma de decisiones
Nivel 3
Definición: Formula alternativas de adquisición, financiamiento y gestión de activos en las organizaciones, con un sustento basado en la creación de valor.

V. UNIDADES DE APRENDIZAJE

UNIDAD Nº: 1 ÉTICA Y ESTÁNDARES PROFESIONALES

LOGRO

Al finalizar la unidad, el estudiante es capaz de comprender y poner en práctica los estándares y procesos claves para mantener la integridad como profesional en el área de finanzas con especial énfasis en el desempeño como analista financiero

TEMARIO

SEMANA 1
- Ética y confianza en la profesión financiera
- Código de ética y estándares profesionales
- Guía respecto a la aplicación de los estándares profesionales

Actividades de aprendizaje
- Análisis de casos
- Resolución de ejercicios

Evidencias de aprendizaje
- Respuesta a los casos
- Simulaciones

SEMANA 2
- Estándares de desempeño global para las inversiones (GIPS)

Actividades de aprendizaje
- Análisis de casos
- Resolución de ejercicios.

Evidencias de aprendizaje
- Respuesta a los casos
- Simulaciones

Bibliografía: 2020 CFA Program Exam Prep Kaplan Schweser Notes, Level 1, Book1, study session 1

HORA(S) / SEMANA(S)

Semana 1 - 2

UNIDAD Nº: 2 MÉTODOS CUANTITATIVOS

LOGRO

Al finalizar la unidad, el estudiante será capaz de manejar y utilizar los conceptos de valor del dinero en el tiempo, estadística descriptiva e inferencial utilizando la calculadora permitida en las evaluaciones CFA. (TI BAII Plus)

TEMARIO

SEMANA 3

- Manejo del valor del dinero en el tiempo a través de la calculadora TI BAII Plus.

Actividades de aprendizaje

- Análisis de casos
- Resolución de ejercicios

Evidencias de aprendizaje

- Respuesta a los casos
- Simulaciones

SEMANA 4

- Manejo de principales conceptos estadísticos utilizando la calculadora TI BAII Plus

Actividades de aprendizaje

- Análisis de casos
- Resolución de ejercicios

Evidencias de aprendizaje

- Respuesta a los casos
- Simulaciones

Bibliografía: 2020 CFA Program Exam Prep Kaplan Schweser Notes, Level 1, Book1, study session 2, and 3

HORA(S) / SEMANA(S)

Semana 3 - 4

UNIDAD Nº: 3 ECONOMÍA

LOGRO

Al finalizar la unidad, el estudiante analiza las decisiones de política monetaria y fiscal, logrando un entendimiento sobre los diferentes enfoques e impactos.

TEMARIO

SEMANA 5

- Política monetaria
- Política fiscal
- Relación entre política monetaria y fiscal
- Comercio Internacional
- Flujo internacional de capitales
- Comercio Internacional
- Comercio y flujos de capitales: Restricciones y tratados
- La balanza de pagos
- Organizaciones de comercio

Actividades de aprendizaje

- Análisis de casos
- Resolución de ejercicios

Evidencias de aprendizaje
- Práctica calificada 1

Bibliografía: 2020 CFA Program Exam Prep Kaplan Schweser Notes, Level 1, Book 2, study session 5

HORA(S) / SEMANA(S)
Semana 4 - 5

UNIDAD Nº: 4 REPORTE Y ANÁLISIS DE EEFF

LOGRO
Al finalizar la unidad, el estudiante aplica las herramientas de análisis financiero para evaluar los activos, pasivos, capital y performance económica de la empresa.

TEMARIO
SEMANA 6
- Estándares para el reporte financiero
- Sistemas de reporte financiero IFRS y GAAP
- Tratamiento impositivo
- Análisis de activos de largo plazo
- Análisis de pasivos de largo plazo

Actividades de aprendizaje
- Análisis de casos
- Resolución de ejercicios

Evidencias de aprendizaje
- Respuesta a los casos
- Simulaciones
- Práctica calificada 1

SEMANA 7
- Calidad de los reportes financieros
- Aplicación del análisis de los EEFF

Actividades de aprendizaje
- Análisis de casos
- Resolución de ejercicios.

Evidencias de aprendizaje
- Respuesta a los casos
- Simulaciones

- SEMANA 8
Evidencias de aprendizaje

- Examen parcial

Bibliografía: 2020 CFA Program Exam Prep Kaplan Schweser Notes, Level 1, Book 3, study sessions 6, 8 and 9

HORA(S) / SEMANA(S)

Semana 6 - 8

UNIDAD Nº: 5 FINANZAS CORPORATIVAS

LOGRO

Al finalizar la unidad, el estudiante estará en capacidad de identificar prácticas adecuadas de gobierno corporativo y como estas crean valor a la empresa. Asimismo, será capaz de evaluar de manera integral el aporte de los diferentes tipos de apalancamiento tanto al potencial de crecimiento como al riesgo de la empresa.

TEMARIO

SEMANA 9

- Gobierno corporativo
- Consideraciones ambientales y de responsabilidad social
- Análisis de Apalancamiento

Actividades de aprendizaje

- Análisis de casos
- Resolución de ejercicios

Evidencias de aprendizaje

- Respuesta a los casos
- Simulaciones
-

Bibliografía: 2020 CFA Program Exam Prep Kaplan Schweser Notes, Level 1, Book 4, study session 10 and 11

HORA(S) / SEMANA(S)

Semana 9

UNIDAD Nº: 6 RENTA VARIABLE

LOGRO

Al finalizar la unidad, el estudiante se encuentra en capacidad de realizar un análisis adecuado de la industria así como de comprender a cabalidad la construcción y uso de los diferentes índices de mercado.

TEMARIO

SEMANA 10

- Construcción y análisis de los índices de mercado
- Definición y cálculo de retornos en índices
- Construcción y manejo de índices
- Uso de índices de mercado

- Índices de renta variable
- Índices de renta fija
- Indices de activos alternativos
- Análisis de la industria
- Enfoques para la identificación de industrias similares
- Sistemas de clasificación de la industria
- Análisis y descripción de las industrias
- Análisis de las compañías

ctividades de aprendizaje
- Análisis de casos
- Resolución de ejercicios

Evidencias de aprendizaje
- Respuesta a los casos
- Simulaciones

Bibliografía: 2020 CFA Program Exam Prep Kaplan Schweser Notes, Level 1, Book 4, study session 12 and 13

HORA(S) / SEMANA(S)

Semana 10

UNIDAD Nº: 7 RENTA FIJA

LOGRO

Al finalizar la unidad, el estudiante se encontrará en capacidad de comprender y analizar los diferentes tipos de activos de renta fija colateralizados

TEMARIO

SEMANA 11
- Introducción a los activos financieros colateralizados
- Funcionamiento de la colateralización
- Préstamos hipotecarios residenciales
- Activos colateralizados por hipotecas residenciales
- Activos colateralizados por hipotecas comerciales
- Activos colateralizados por activos nos hipotecarios
- Activos colateralizados por deuda

Actividades de aprendizaje
- Análisis de casos
- Resolución de ejercicios

Evidencias de aprendizaje
- Respuesta a los casos
- Simulaciones

Bibliografía: 2020 CFA Program Exam Prep Kaplan Schweser Notes, Level 1, Book 4, study sessions 14 and 15

HORA(S) / SEMANA(S)

Semana 11

UNIDAD Nº: 8 INVERSIONES ALTERNATIVAS

LOGRO

Al finalizar la unidad, el estudiante se encontrará en capacidad de comprender y analizar los diferentes instrumentos alternativos de inversión

TEMARIO

SEMANA 12

- Hedge Funds
- Private Equity
- Bienes Raices
- Commodities
- Infraestructura
- Otras inversiones alternativas

Actividades de aprendizaje

- Análisis de casos
- Resolución de ejercicios

Evidencias de aprendizaje

- Práctica Calificada 2

Bibliografía: 2020 CFA Program Exam Prep Kaplan Schweser Notes, Level 1, Book 5, study session 17

HORA(S) / SEMANA(S)

Semana 12

UNIDAD Nº: 9 MANEJO DE PORTAFOLIO

LOGRO

Al finalizar la unidad, el estudiante se encontrará en capacidad de comprender y analizar los diferentes instrumentos alternativos de inversión

TEMARIO

SEMANA 13

- Planeamiento y construcción de portafolio
- Evaluación del rendimiento
- Manejo de riesgos

SEMANA 14

- Análisis Técnico
- Fintech y manejo de portafolio

SEMANA 15

- Repaso General
- Estrategias para examen CFA

Actividades de aprendizaje
- Análisis de casos
- Resolución de ejercicios

Evidencias de aprendizaje
- Respuesta a los casos
- Simulaciones

SEMANA 16
Evidencias de aprendizaje
- Examen Final
Bibliografía: 2020 CFA Program Exam Prep Kaplan Schweser Notes, Level 1, Book 5, study session 18

HORA(S) / SEMANA(S)
Semana 13 - 16

VI. METODOLOGÍA

El Modelo Educativo de la UPC asegura una formación integral, que tiene como pilar el desarrollo de competencias, las que se promueven a través de un proceso de enseñanza-aprendizaje donde el estudiante cumple un rol activo en su aprendizaje, construyéndolo a partir de la reflexión crítica, análisis, discusión, evaluación, exposición e interacción con sus pares, y conectándolo con sus experiencias y conocimientos previos. Por ello, cada sesión está diseñada para ofrecer al estudiante diversas maneras de apropiarse y poner en práctica el nuevo conocimiento en contextos reales o simulados, reconociendo la importancia que esto tiene para su éxito profesional.

Se asignarán lecturas cada semana.

Se utilizará la metodología de solución de ejercicios y casos para que el alumno aplique los conceptos y criterios vertidos en clase en el análisis y solución de problemas. de sus habilidades.

Se realizará seguimiento permanente durante el periodo de estudio en español e inglés.

El alumno debe dedicar un mínimo de 5 horas semanales al curso para llevarlo de manera exitosa.

VII. EVALUACIÓN

FÓRMULA

15% (PC1) + 15% (PC2) + 30% (EA1) + 30% (EB1) + 10% (PA1)

TIPO DE NOTA	PESO %
PC - PRÁCTICAS PC	15
EA - EVALUACIÓN PARCIAL	30
PC - PRÁCTICAS PC	15
PA - PARTICIPACIÓN	10
EB - EVALUACIÓN FINAL	30

VIII. CRONOGRAMA

TIPO DE PRUEBA	DESCRIPCIÓN NOTA	NÚM. DE PRUEBA	FECHA	OBSERVACIÓN	RECUPERABLE
PC	PRÁCTICAS PC	1	Sem 5	Evaluación individual presencial. Evidencia de aprendizaje: Prueba escrita, incluye hasta la Unid. 3. Competencia evaluada: Toma de decisiones	SÍ
EA	EVALUACIÓN PARCIAL	1	Sem 8	Evaluación individual presencial. Evidencia de aprendizaje: Prueba escrita, incluye hasta la Unid. 4. Competencia evaluada: Toma de decisiones.	SÍ
PC	PRÁCTICAS PC	2	Sem 12	Evaluación individual presencial. Evidencia de aprendizaje: Prueba escrita, incluye hasta la Unid. 8. Competencia evaluada: Toma de decisiones.	SÍ
PA	PARTICIPACIÓN	1	Sem 15	Evaluación individual presencial todas las semanas. Evidencia de Aprendizaje: Sustentación oral, incluye los temas de clase. Competencia evaluada: Toma de decisiones.	NO
EB	EVALUACIÓN FINAL	1	Sem 16	Evaluación individual presencial. Evidencia de aprendizaje: Prueba escrita, incluye todas las Unids. Competencia evaluada: Toma de decisiones.	SÍ

IX. BIBLIOGRAFÍA DEL CURSO

https://upc.alma.exlibrisgroup.com/leganto/readinglist/lists/9802694090003391?institute=51UPC_INST&auth=LOCAL

ANEXO

En este anexo, se encuentran los reglamentos que todo alumno está obligado a leer y a cumplir en su rol de estudiante universitario en la UPC.

REGLAMENTO DE DISCIPLINA DE ALUMNOS :

https://sica.upc.edu.pe/categoria/reglamentos-upc/sica-reg-26-reglamento-de-disciplina-de-alumnos

REGLAMENTO PARA LA PREVENCIÓN E INTERVENCIÓN EN CASOS DE HOSTIGAMIENTO SEXUAL- UPC:

https://sica.upc.edu.pe/categoria/normalizacion/sica-reg-31-reglamento-para-la-prevencion-e-intervencion-en-casos-de-hostiga