



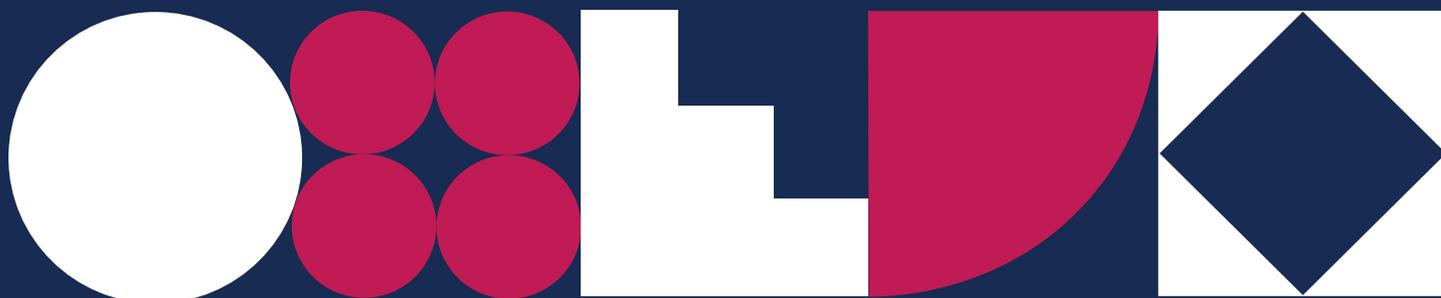
**PUCP**

Facultad de  
Ciencias Sociales

—  
Especialidad de  
Finanzas

# Plan de Estudios Finanzas

 <https://facultad.pucp.edu.pe/ciencias-sociales/>



# 1. DATOS GENERALES

El nuevo Plan de Estudios se aplicaría obligatoriamente a todos los estudiantes que ingresen a la Facultad de Ciencias Sociales a partir del ciclo 2022-2 y aquellos que estén hasta el octavo ciclo de la carrera. Los alumnos de noveno y décimo ciclo podrán elegir si se cambian o no de Plan. El Plan antiguo (M001557) estará abierto hasta el semestre 2023-2. Otro caso excepcional es de los estudiantes de Transferencia Interna y Cambio de Especialidad. La dirección de carrera evaluará cada caso y decidirá lo mejor.

**La carrera de Finanzas comprende 10 niveles de estudio.** La Facultad de Estudios Generales Letras es responsable de la formación académica del primer al cuarto nivel.

Hay dos ramas principales de las finanzas. Una de ellas, finanzas corporativas, que analiza las modalidades de financiamiento de una empresa, incluyendo mediante el uso de instrumentos de capital o de deuda, y su mezcla óptima. La segunda es la gestión de portafolios o inversiones, que analiza las alternativas de inversión (y ahorro) disponibles a los agentes a fines de rentabilizar sus fondos disponibles para ahorro/inversión. Estas dos ramas principales, a su vez, se subdividen en otras ramas más específicas u otras que han ido surgiendo con el avance de la disciplina, incluyendo Intermediación Financiera, Microfinanzas, Finanzas Personales o del Consumidor, Finanzas Públicas, Finanzas Conductuales, entre otras.

## Obtención del Grado de Bachiller/a en Ciencias Sociales

El/la estudiante, al concluir el plan de estudios de la Facultad, recibe el grado académico de Bachiller/a en Ciencias Sociales con mención en su especialidad. En concordancia con la Ley Universitaria 30220, para recibir el grado de Bachiller/a el/la estudiante debe cumplir con lo siguiente:

- **Haber aprobado los 120 créditos del plan de estudios de Finanzas**, de los cuales 94 créditos corresponden a cursos obligatorios y 26 créditos corresponden a los cursos electivos.
  - Dentro de estos 26 créditos, el/la estudiante puede llevar un máximo de 8 créditos de otra especialidad.

- **Aprobar el Trabajo de Investigación para el Bachillerato (TIB)** según las normas de la universidad y de la Facultad.
- **Convalidar las prácticas pre-profesionales**, bajo la aprobación de la especialidad a través de validación de las constancias de **240 horas de prácticas**.
- **Acreditar el conocimiento del idioma inglés a nivel intermedio** por medio de tres modalidades: aprobarlo en Idiomas Católica; acreditar el idioma mediante un examen o convalidar estudios en otras instituciones autorizadas.

## Obtención del Título de Licenciado/a

Para recibir el título de Licenciado/a en una de las especialidades de la Facultad de Ciencias Sociales, el/la estudiante debe cumplir con lo siguiente:

- Haber obtenido el grado de Bachiller/a en Ciencias Sociales con mención en su especialidad en la Facultad de Ciencias Sociales de la PUCP.
- Presentar y aprobar una tesis, o...
- Con dos o más años de la obtención del Bachillerato en la Facultad de Ciencias Sociales de la PUCP y de experiencia laboral en el campo disciplinar de su formación, presentar y aprobar un Trabajo de Suficiencia Profesional (TSP).
  - Se deberá participar del Taller de asesorías para Tesis y Trabajo de Suficiencia Profesional de bachilleres de Ciencias Sociales PUCP que, una vez concluido y aprobado, permite contar con un informe favorable del asesor para iniciar el proceso de titulación.
  - Se deberá entregar un currículum documentado que sustente la experiencia profesional en el campo disciplinar por mínimo 2 años.

## 2. ¿Cómo obtengo el grado de bachiller?

En concordancia con la **Ley Universitaria 30220**, para recibir el grado de Bachiller/a el/la estudiante debe cumplir con lo siguiente:

**1**

**Haber aprobado los 120 créditos (94 obligatorios y 26 electivos)**

**Aprobar el TIB: Trabajo de Investigación para el Bachillerato**

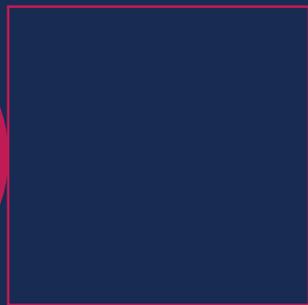
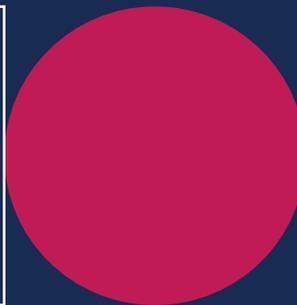
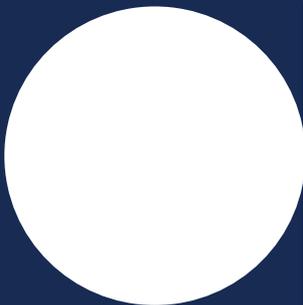
**2**

**3**

**Convalidar las prácticas pre-profesionales**

**Acreditar el conocimiento del idioma inglés a nivel intermedio**

**4**



# 3. PERFIL DE EGRESO

El Estado, las empresas e instituciones requieren de profesionales en finanzas para gestionar de forma eficiente los recursos con los que cuentan.

## Campo laboral

El egresado de la especialidad de Finanzas se puede desempeñar en:

- El Sector público y privado, ejerciendo funciones de análisis y estrategia, contribuyendo con los elementos de economía y finanzas en la dirección, planificación gerencia y asesoramiento en empresas no financieras, incluyendo emprendimientos.
- Empresas consultoras tanto de temas financieros en general como de financiamiento de proyectos.
- Empresas del sistema financiero y de microfinanzas: bancos, financieras, entidades microfinancieras.
- Empresas de seguros, mercado de capitales dedicado a intermediación directa e inversiones: casas de bolsa, fondos de inversión, bancos de inversión, fondos de pensiones, etc.

# 4. Malla Curricular

NIVEL 5	NIVEL 6	NIVEL 7	NIVEL 8	NIVEL 9	NIVEL 10
MICROECONOMÍA 1 5 créditos	MICROECONOMÍA FINANCIERA 4 créditos	FUNDAMENTOS DE ECONOMETRÍA 5 créditos	ECONOMETRÍA FINANCIERA 5 créditos	SEMINARIO DE TESIS EN FINANZAS 1 5 créditos	SEMINARIO DE TESIS EN FINANZAS 2 5 créditos
MACROECONOMÍA 1 5 créditos	ANÁLISIS FINANCIERO 2 4 créditos	FINANZAS CORPORATIVAS 2 4 créditos	DERECHO CORPORATIVO Y FINANCIERO 3 créditos	GESTIÓN BANCARIA 3 créditos	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD O DE OTRA ÁREA
ANÁLISIS FINANCIERO 1 4 créditos	FINANZAS CUANTITATIVAS 2 5 créditos	ACTIVIDAD EN FINANZAS 1: BLOOMBERG 1 crédito	ÉTICA PARA LAS FINANZAS 2 créditos	ELECTIVO OBLIGATORIO DE RESPONSABILIDAD SOCIAL	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD O DE OTRA ÁREA
FINANZAS CUANTITATIVAS 1 5 créditos	FINANZAS CORPORATIVAS 1 4 créditos	DERIVADOS FINANCIEROS 3 créditos	TEORÍA Y GESTIÓN DE PORTAFOLIOS 4 créditos	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD O DE OTRA ÁREA	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD O DE OTRA ÁREA
	FINANZAS INTERNACIONALES 3 créditos	INSTRUMENTOS FINANCIEROS 4 créditos	INTRODUCCIÓN A LA GESTIÓN DE RIESGOS 4 créditos	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD O DE OTRA ÁREA	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD O DE OTRA ÁREA
		EVALUACIÓN PRIVADA Y SOCIAL DE PROYECTOS 4 créditos	PROGRAMACIÓN EN FINANZAS 3 créditos	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD O DE OTRA ÁREA	

# 5. PLAN DE ESTUDIOS DETALLADO

## NIVEL 5

### Cursos obligatorios

Clave	Nombre del curso	Tipo de curso	Créditos	Requisitos
ECO255	MICROECONOMÍA 1	Obligatorio (OBL)	5.00	ECO113 (07) y 1MAT27 (07)
ECO290	MACROECONOMÍA 1	Obligatorio (OBL)	5.00	1MAT27 (07) y ECO114 (07)
1FIN02	ANALISIS FINANCIERO 1	Obligatorio (OBL)	4.00	Créd. Aprob. Totales: 60.00
1FIN18	FINANZAS CUANTITATIVAS 1	Obligatorio (OBL)	5.00	1MAT27 (07)

## NIVEL 6

### Cursos obligatorios

Clave	Nombre del curso	Tipo de curso	Créditos	Requisitos
FIN203	MICROECONOMÍA FINANCIERA	Obligatorio (OBL)	4.00	ECO255 (07)
1FIN03	ANALISIS FINANCIERO 2	Obligatorio (OBL)	4.00	1FIN02 (07)
1FIN04	FINANZAS CUANTITATIVAS 2	Obligatorio (OBL)	5.00	1FIN18 (07)
1FIN07	FINANZAS CORPORATIVAS 1	Obligatorio (OBL)	4.00	1FIN02 (07)
1FIN27	FINANZAS INTERNACIONALES	Obligatorio (OBL)	3.00	ECO290 (07)

## NIVEL 7

### Cursos obligatorios

Clave	Nombre del curso	Tipo de curso	Créditos	Requisitos
FIN210	FINANZAS CORPORATIVAS 2	Obligatorio (OBL)	4.00	1FIN07 (07)
1ECO11	FUNDAMENTOS DE ECONOMETRÍA	Obligatorio (OBL)	5.00	1FIN04 (07)
1FIN06	INSTRUMENTOS FINANCIEROS	Obligatorio (OBL)	4.00	[1FIN03 (07) o 1FIN07 (07)]
1FIN36	DERIVADOS FINANCIEROS	Obligatorio (OBL)	3.00	[1FIN03 (07) o 1FIN07 (07)]
1FIN37	EVALUACIÓN PRIVADA Y SOCIAL DE PROYECTOS	Obligatorio (OBL)	4.00	1FIN02 (07)
1FIN39	ACTIVIDAD EN FINANZAS 1: BLOOMBERG	Obligatorio (OBL)	1.00	Créd. en Especialidad: 30.00

## NIVEL 8

### Cursos obligatorios

Clave	Nombre del curso	Tipo de curso	Créditos	Requisitos
FIN214	ECONOMETRÍA FINANCIERA	Obligatorio (OBL)	5.00	1ECO11 (07)
1DER07	DERECHO CORPORATIVO Y FINANCIERO	Obligatorio (OBL)	3.00	[1FIN03 (07) o 1FIN07 (07)]

1FIN08	ÉTICA PARA LAS FINANZAS	Obligatorio (OBL)	2.00	1FIN07 (07) y 1FIN03 (07)
1FIN09	TEORÍA Y GESTIÓN DE PORTAFOLIOS	Obligatorio (OBL)	4.00	1FIN07 (07)
1FIN10	INTRODUCCIÓN A LA GESTIÓN DE RIESGOS	Obligatorio (OBL)	4.00	1FIN02 (07) y FIN203 (07)
1FIN14	PROGRAMACIÓN EN FINANZAS	Obligatorio (OBL)	3.00	1FIN18 (07) y 1FIN04 (07)

## NIVEL 9

### Cursos obligatorios

Clave	Nombre del curso	Tipo de curso	Créditos	Requisitos
1FIN34	SEMINARIO DE TESIS EN FINANZAS 1	Obligatorio (OBL)	5.00	Créd. en Especialidad: 70.00; 1ECO11 (07)
1FIN11	GESTIÓN BANCARIA	Obligatorio (OBL)	3.00	1FIN03 (07) y 1FIN10 (07)

### Tipos de electivo del NIVEL 9

Tipo de curso electivo	Cantidad de cursos	Total de créditos
Electivo de la especialidad o de otra área (EOO)	3	9.00
Electivo - obligatorio de responsabilidad social (EBR)	1	3.00

## NIVEL 10

### Cursos obligatorios

Clave	Nombre del curso	Tipo de curso	Créditos	Requisitos
IDM304	IDIOMAS	Obligatorio (OBL)	0.00	
1FIN35	SEMINARIO DE TESIS EN FINANZAS 2	Obligatorio (OBL)	5.00	1FIN34 (07) y FIN214 (07)
1FIN46	PRÁCTICAS PRE-PROFESIONALES EN FINANZAS	Obligatorio (OBL)	0.00	Créd. en Especialidad: 70.00
1TIB26	TRABAJO DE INVESTIGACIÓN PARA BACHILLERATO	Obligatorio (OBL)	0.00	

### Tipos de electivo del NIVEL 10

Tipo de curso electivo	Cantidad de cursos	Total de créditos
Electivo de la especialidad o de otra área (EOO)	5	14.00

### Electivo - obligatorio de responsabilidad social (EBR)

Clave	Nombre del curso	Tipo de curso	Créditos	Requisitos
FIN220	MICROFINANZAS	ELECTIVO - OBLIGATORIO RESPONSABILIDAD SOCIAL (EBR)	3.00	FIN203 (07)
1FIN47	FINANZAS SOSTENIBLES	ELECTIVO - OBLIGATORIO RESPONSABILIDAD SOCIAL (EBR)	3.00	FIN210 (07)

**Electivo de la especialidad (EES)**

<b>Clave</b>	<b>Nombre del curso</b>	<b>Tipo de curso</b>	<b>Créditos</b>	<b>Requisitos</b>
FIN219	INSTRUMENTOS DERIVADOS 2	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD (EES)	3.00	1FIN36 (07)
FIN222	TÓPICOS DE ECONOMETRÍA FINANCIERA	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD (EES)	3.00	FIN214 (07)
1FIN19	ACTIVOS ALTERNATIVOS	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD (EES)	3.00	1FIN07 (07)
1FIN22	TOPICOS AVANZADOS DE RIESGOS	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD (EES)	3.00	1FIN38 (07)
1FIN23	ACTIVIDAD EN FINANZAS 3	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD (EES)	1.00	Cred. en Especialidad: 50.00
1FIN24	PREPARACION PARA CERTIFICACIONES	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD (EES)	3.00	1FIN03 (07) y 1FIN09 (07) y FIN210 (07)
1FIN25	FINANZAS CUANTITATIVAS AVANZADAS	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD (EES)	3.00	1FIN04 (07) y 1FIN36 (07)
1FIN26	FINANCIAMIENTO DE PROYECTOS PUBLICO PRIVADOS	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD (EES)	3.00	FIN210 (07) y 1FIN10 (07) y 1FIN37 (07)
1FIN30	ECONOMÍA FINANCIERA Y BANCARIA	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD (EES)	3.00	1FIN02 (07)
1FIN31	REGULACIÓN FINANCIERA	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD (EES)	3.00	1FIN02 (07)
1FIN32	TEMAS EN FINANZAS 1	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD (EES)	3.00	
1FIN33	TEMAS EN FINANZAS 2	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD (EES)	3.00	
1FIN38	GESTIÓN DE RIESGO AVANZADA (P)	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD (EES)	3.00	1FIN10 (07)
1FIN40	ACTIVIDAD EN FINANZAS 2	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD (EES)	1.00	Cred. en Especialidad: 50.00
1FIN41	MODELOS ACTUARIALES 1	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD (EES)	3.00	1FIN04 (07)
1FIN42	MODELOS ACTUARIALES 2	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD (EES)	3.00	1FIN41 (07)
1FIN43	FINANZAS CONDUCTUALES Y EXPERIMENTALES	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD (EES)	3.00	FIN203 (07) y 1ECO11 (07)
1FIN44	MACHINE LEARNING PARA FINANZAS	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD (EES)	3.00	FIN214 (07) y 1FIN14 (07)
1FIN45	PRIVATE EQUITY, VENTURE CAPITAL Y FINTECH	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD (EES)	3.00	[1FIN09 (07) o FIN210 (07)]
1FIN48	GESTIÓN DE RIESGO AVANZADA (SP)	ELECTIVO DE LA ESPECIALIDAD (EES)	3.00	1FIN10 (07)

Electivo de otra área / especialidad (EOE)				
Clave	Nombre del curso	Tipo de curso	Créditos	Requisitos
CIS300	METODOLOGÍAS VISUALES PARA LA INVESTIGACIÓN SOCIAL	Electivo de otra área/especialidad (EOE)	3.00	
CIS303	SEMINARIO DE TEMAS EN CIENCIAS SOCIALES	Electivo de otra área/especialidad (EOE)	3.00	
CIS311	ACTIVIDADES EN CIENCIAS SOCIALES 1	Electivo de otra área/especialidad (EOE)	1.00	
CIS312	ACTIVIDADES EN CIENCIAS SOCIALES 2	Electivo de otra área/especialidad (EOE)	1.00	
CIS313	ACTIVIDADES EN CIENCIAS SOCIALES 3	Electivo de otra área/especialidad (EOE)	1.00	
FIL255	FILOSOFÍA SOCIAL	Electivo de otra área/especialidad (EOE)	3.00	
1INT33	SEMINARIO INTERDISCIPLINARIO DE TEMAS EN CIENCIAS SOCIALES 1	Electivo de otra área/especialidad (EOE)	3.00	
1INT34	SEMINARIO INTERDISCIPLINARIO DE TEMAS EN CIENCIAS SOCIALES 2	Electivo de otra área/especialidad (EOE)	3.00	
1INT41	SEMINARIO INTERNACIONAL DE CIENCIAS SOCIALES 1	Electivo de otra área/especialidad (EOE)	1.00	
1INT42	SEMINARIO INTERNACIONAL DE CIENCIAS SOCIALES 2	Electivo de otra área/especialidad (EOE)	1.00	
1INT43	SEMINARIO INTERNACIONAL DE CIENCIAS SOCIALES 3	Electivo de otra área/especialidad (EOE)	1.00	
1INT46	TALLER DE HERRAMIENTAS CUANTITATIVAS PARA EL ANÁLISIS SOCIAL 2	Electivo de otra área/especialidad (EOE)	2.00	
1INT44	TALLER DE HERRAMIENTAS CUALITATIVAS PARA EL ANÁLISIS SOCIAL	Electivo de otra área/especialidad (EOE)	2.00	
1INT45	TALLER DE HERRAMIENTAS CUANTITATIVAS PARA EL ANÁLISIS SOCIAL1	Electivo de otra área/especialidad (EOE)	2.00	
1INT47	TALLER DE HERRAMIENTAS CUANTITATIVAS PARA EL ANÁLISIS SOCIAL 3	Electivo de otra área/especialidad (EOE)	2.00	

Electivo de otra área / especialidad (EOE)				
Clave	Nombre del curso	Tipo de curso	Créditos	Requisitos
GES208	TEORÍA ORGANIZACIONAL	Electivo tipo A (E-A)	3.00	Créd. en Especialidad: 50.00
1REI01	TEORÍA DE LAS RELACIONES INTERNACIONALES 1	Electivo tipo A (E-A)	4.00	Créd. en Especialidad: 50.00
1REI02	HISTORIA DE LAS RELACIONES INTERNACIONALES	Electivo tipo A (E-A)	4.00	Créd. en Especialidad: 50.00
1ECO14	ECONOMÍA MONETARIA	Electivo tipo A (E-A)	4.00	1FIN27 (07)
ECO381	TEORÍA DE LA REGULACIÓN	Electivo tipo A (E-A)	3.00	FIN203 (07)
1ECO43	TEORÍA DE JUEGOS	Electivo tipo A (E-A)	3.00	FIN203 (07)

1ECO15	ORGANIZACIÓN INDUSTRIAL	Electivo tipo A (E-A)	4.00	FIN203 (07)
1ECO37	EVALUACIÓN SOCIAL DE PROYECTOS	Electivo tipo A (E-A)	3.00	1FIN37 (07)
1ECO30	LABORATORIO DE CÓMPUTO: MANEJO DE BASES DE DATOS	Electivo tipo A (E-A)	2.00	1ECO11 (07)
1ECO31	LABORATORIO DE ECONOMETRÍA: STATA	Electivo tipo A (E-A)	2.00	1ECO11 (07)
1ECO32	LABORATORIO DE ECONOMETRÍA: MATLAB	Electivo tipo A (E-A)	2.00	1ECO11 (07)
1ECO33	LABORATORIO DE ECONOMETRÍA: EVIEWS	Electivo tipo A (E-A)	2.00	1ECO11 (07)
1ECO34	LABORATORIO DE ECONOMETRÍA: ARCGIS	Electivo tipo A (E-A)	2.00	1ECO11 (07)
1ECO35	LABORATORIO DE PROGRAMACIÓN: R Y PYTHON	Electivo tipo A (E-A)	2.00	1ECO11 (07)
POL245	DERECHO INTERNACIONAL PÚBLICO	Electivo tipo A (E-A)	3.00	Créd. en Especialidad: 50.00
POL238	TEORÍA DEL ESTADO	Electivo tipo A (E-A)	4.00	Créd. en Especialidad: 50.00
1POL01	POLÍTICAS PÚBLICAS	Electivo tipo A (E-A)	4.00	Créd. en Especialidad: 50.00
1POL02	GESTIÓN PÚBLICA	Electivo tipo A (E-A)	4.00	Créd. en Especialidad: 50.00
GES232	GESTIÓN ESTRATÉGICA	Electivo tipo A (E-A)	4.00	Créd. en Especialidad: 50.00
GES235	PLAN DE NEGOCIOS	Electivo tipo A (E-A)	4.00	Créd. en Especialidad: 50.00
CON286	TRIBUTACIÓN CONTABLE 1	Electivo tipo A (E-A)	4.00	Créd. en Especialidad: 50.00
CON297	EVALUACIÓN DE LA INFORMACIÓN FINANCIERA	Electivo tipo A (E-A)	4.00	Créd. en Especialidad: 50.00
MAT600	FUNDAMENTOS DE ANÁLISIS REAL	Electivo tipo A (E-A)	4.00	1FIN04 (07)
MAT799	ALGEBRA LINEAL NUMÉRICA	Electivo tipo A (E-A)	4.00	1FIN04 (07)
MAT833	MEDIDA Y PROBABILIDAD	Electivo tipo A (E-A)	4.00	1FIN04 (07)
EST621	PROCESOS ESTOCÁSTICOS	Electivo tipo A (E-A)	4.00	1FIN04 (07)
MAT693	CONCAVIDAD Y OPTIMIZACIÓN	Electivo tipo A (E-A)	4.00	1FIN04 (07)
MAT834	ECUACIONES DIFERENCIALES APLICADAS	Electivo tipo A (E-A)	4.00	1FIN04 (07)
EST600	ECUACIONES DIFERENCIALES ESTOCÁSTICAS	Electivo tipo A (E-A)	4.00	1FIN04 (07)
ECO822	TEORÍA FINANCIERA AVANZADA	Electivo tipo A (E-A)	3.00	1FIN09 (07)

### Tipo de requisitos

**04** = Haber cursado o cursar simultáneamente. **05** = Haber aprobado o cursar simultáneamente. **06** = Promedio de notas no menor de 08. **07** = Haber aprobado el curso.

# 6. CONCENTRACIONES EN FINANZAS

Se otorgarán constancias con el fin de fortalecer las competencias especializadas de los estudiantes de Finanzas.

Sólo se podrá obtener constancia de una concentración, llevando un mínimo de 15 créditos en los cursos siguientes:

- **Concentración en Finanzas Corporativas Avanzada**

**Electivos obligatorios:** Finanzas Sostenibles (Microfinanzas deberá llevarse como Electivo-obligatorio RSU), Finanzas Conductuales y Experimentales y Private Equity, Venture Capital y Fintech

**Electivos:** Regulación Financiera, Actividad en Finanzas 2 y 3, cursos grupos 1, 3 y 4

- **Concentración en Intermediación Financiera Avanzada**

**Electivos obligatorios:** Regulación Financiera, Microfinanzas (Finanzas Sostenibles deberá llevarse como Electivo-obligatorio RSU) y Gestión de Riesgo Avanzada (P o SP) o Machine Learning para Finanzas

**Electivos:** Modelos Actuariales 1 y 2, Gestión de Riesgo Avanzada (P o SP) o Machine Learning para Finanzas, Tópicos de Econometría Financiera, Actividad en Finanzas 2 y 3, Economía Monetaria, Economía Financiera y Bancaria, cursos grupo 2

- **Concentración en Inversiones y Actuarial Avanzada**

**Electivos obligatorios:** Finanzas Sostenibles (Microfinanzas deberá llevarse como Electivo-obligatorio RSU), Modelos Actuariales 1y Activos Alternativos o Private Equity, Venture Capital y Fintech

**Electivos:** Finanzas Conductuales y Experimentales, Activos Alternativos o Private Equity, Venture Capital y Fintech, Modelos Actuariales 2, Instrumentos Derivados 2, Machine Learning para Finanzas, Actividad en Finanzas 2 y 3, cursos grupos 2 y 5

### Grupo 1

- 1ECO14 Economía Monetaria
- ECO381 Teoría de la Regulación
- 1ECO43 Teoría de Juegos
- 1ECO15 Organización Industrial
- 1ECO37 Evaluación Social de Proyectos

### Grupo 2

- 1ECO30 Laboratorio de cómputo: manejo de bases de datos
- 1ECO31 Laboratorio de econometría: Stata
- 1ECO32 Laboratorio de econometría: Matlab
- 1ECO33 Laboratorio de econometría: Eviews
- 1ECO34 Laboratorio de econometría: ArcGIS
- 1ECO35 Laboratorio de programación: R y Python

### Grupo 3

- POL245 Derecho Internacional Público
- POL238 Teoría del Estado
- 1POL01 Políticas Públicas
- 1POL02 Gestión Pública
- 1REI01 Teoría de las Relaciones Internacionales 1
- 1REI02 Historia de las Relaciones Internacionales

#### Grupo 4

- GES208 Teoría Organizacional
- GES232 Gestión Estratégica
- GES235 Plan de Negocios
- CON286 Tributación Contable 1
- CON297 Evaluación de la Información Financiera

#### Grupo 5

- MAT600 Fundamentos de Análisis Real
- MAT799 Álgebra Lineal Numérica
- MAT833 Medida y Probabilidad
- EST621 Procesos Estocásticos
- MAT693 Concavidad y Optimización
- MAT834 Ecuaciones Diferenciales Aplicadas
- EST600 Ecuaciones Diferenciales Estocásticas
- ECO822 Teoría Financiera Avanzada

# Creación de concentraciones en finanzas

Existen distintas ramas de las finanzas las cuales requieren de distintos contenidos de profundización. Sin embargo, no es posible cubrirlos todos en la currícula de cursos obligatorios. Por ello, para aquellos estudiantes que deseen profundizar sus conocimientos en alguna rama de las finanzas, se propone ofrecer concentraciones en las tres principales ramas (Corporativa, Intermediación Financiera e Inversiones y Actuarial). Cumplidos los requisitos, los estudiantes obtendrán una constancia de la Facultad.

**1. Objetivo:** Ofrecer a los estudiantes la posibilidad de llevar cursos de profundización que les permita obtener una constancia de concentración de la Facultad en una de las tres principales ramas de las finanzas, de manera de lograr una mejor señalización e inserción a segmentos especializados del mercado laboral en finanzas.

**2. Descripción:** Las concentraciones están orientadas a los estudiantes de la Especialidad de Finanzas que deseen profundizar sus conocimientos en alguna de las tres principales ramas de las finanzas, a fin de orientarse a segmentos especializados del mercado laboral. Cada concentración requiere cursar un bloque de cursos (electivos) que son considerados obligatorios para la concentración, un bloque de electivo-obligatorios y otro bloque de cursos seleccionados de entre los electivos dentro de especialidad o de articulación horizontal o vertical incorporados al Plan de Estudios de Finanzas. Como mínimo se requieren 15 créditos distribuidos en los grupos antes señalados. Solo se podrá obtener constancia de una concentración, independientemente de si cumplen los requisitos para más de una.

**a. Concentración 1: Concentración en Finanzas Corporativas Avanzada.** Orientada a profundizar los conocimientos relacionados a la gestión financiera de las organizaciones bajo un enfoque de sostenibilidad.

Clave	Nombre del curso**	Tipo* (Obligatorio/Electivo)	Créditos	Horas		
				H.T.	H.P.	H/ sem
<b>Bloque obligatorio de concentración (9 créditos):</b>						
1FIN47 (FIN220)	Finanzas Sostenibles (Microfinanzas RSU)	Electivo - obligatorio responsabilidad social	3	3	0	3
1FIN43	Finanzas Conductuales y Experimentales	Electivo dentro de especialidad	3	3	0	3
1FIN45	Private Equity, Venture Capital y Fintech	Electivo dentro de especialidad	3	3	0	3

Bloque electivo (6 créditos mínimo):						
1FIN31	Regulación Financiera	Electivo de la especialidad	3	3	0	3
1FIN40	Actividad en Finanzas 2	Electivo de la especialidad	1	1	0	1
1FIN23	Actividad en Finanzas 3	Electivo de la especialidad	1	0	2	2
1ECO14	Economía Monetaria	Electivo tipo A	4	4	0	4
ECO381	Teoría de la regulación	Electivo tipo A	3	3	0	3
1ECO43	Teoría de juegos	Electivo tipo A	3	3	0	3
1ECO15	Organización Industrial	Electivo tipo A	4	3.5	0	3.5
1ECO37	Evaluación Social de Proyectos	Electivo tipo A	3	3	0	3
POL245	Derecho Internacional Público	Electivo tipo A	3	3	0	3
POL238	Teoría del Estado	Electivo tipo A	4	3	2	5
1POL01	Políticas Públicas	Electivo tipo A	4	3	2	5
1POL02	Gestión Pública	Electivo tipo A	4	3	2	5
1REI01	Teoría de las Relaciones Internacionales 1	Electivo tipo A	4	3	2	5
1REI02	Historia de las Relaciones Internacionales	Electivo tipo A	4	4	0	4
GES208	Teoría Organizacional	Electivo tipo A	3	3	0	3
GES232	Gestión Estratégica	Electivo tipo A	4	4	0	4
GES235	Plan de Negocios	Electivo tipo A	4	4	0	4
CON286	Tributación Contable 1	Electivo tipo A	4	4	0	4
CON297	Evaluación de la Información Financiera	Electivo tipo A	4	3	2	5

\* Tipo de curso en los planes de estudios de pregrado

\*\* En caso de existir agrupaciones de cursos opcionales se debe indicar esta agrupación y los cursos que la conforman.

**b. Concentración 2: Concentración en Inversiones y Actuarial Avanzada.**  
Orientada a profundizar los conocimientos relacionados a la gestión de inversiones y a las decisiones relacionadas a riesgos de vida y previsión social bajo un enfoque de sostenibilidad.

Clave	Nombre del curso**	Tipo* (Obligatorio/Electivo)	Créditos	Horas		
				H.T.	H.P.	H/ sem
<b>Bloque obligatorio de concentración (6 créditos):</b>						
1FIN47 (FIN220)	Finanzas Sostenibles (Microfinanzas RSU)	Electivo - obligatorio responsabilidad social	3	3	0	3
1FIN41	Modelos Actuariales 1	Electivo de la especialidad	3	2	2	4
<b>Bloque electivo - obligatorio de concentración (3 créditos):</b>						
1FIN45	Private Equity, Venture Capital y Fintech	Electivo de la especialidad	3	3	0	3
1FIN19	Activos Alternativos	Electivo de la especialidad	3	3	0	3
<b>Bloque electivo (6 créditos mínimo):</b>						
1FIN45	Private Equity, Venture Capital y Fintech	Electivo de la especialidad	3	3	0	3
1FIN19	Activos Alternativos	Electivo de la especialidad	3	3	0	3
1FIN43	Finanzas Conductuales y Experimentales	Electivo de la especialidad	3	3	0	3
1FIN42	Modelos Actuariales 2	Electivo de la especialidad	3	2	2	4
FIN219	Instrumentos Derivados 2	Electivo de la especialidad	3	3	0	3
1FIN44	Machine Learning para Finanzas	Electivo de la especialidad	3	2	2	4
1FIN40	Actividad en Finanzas 2	Electivo de la especialidad	1	1	0	1
1FIN23	Actividad en Finanzas 3	Electivo de la especialidad	1	0	2	2
1ECO30	Laboratorio de cómputo: Manejo de bases de datos	Electivo tipo A	2	0	3	3
1ECO31	Laboratorio de Econometría: STATA	Electivo tipo A	2	0	3	3
1ECO32	Laboratorio de Econometría: MATLAB	Electivo tipo A	2	0	3	3

1ECO33	Laboratorio de Econometría: Eviews	Electivo tipo A	2	0	3	3
1ECO34	Laboratorio de Econometría: ArcGis	Electivo tipo A	2	0	3	3
1ECO35	Laboratorio de Programación: R y Python	Electivo tipo A	2	0	3	3
MAT600	Fundamentos de Análisis Real	Electivo tipo A	4	3	2	5
MAT799	Álgebra Lineal Numérica	Electivo tipo A	4	3	2	5
MAT833	Medida y Probabilidad	Electivo tipo A	4	4	0	4
EST621	Procesos Estocásticos	Electivo tipo A	4	3	2	5
MAT693	Concavidad y Optimización	Electivo tipo A	4	4	0	4
MAT834	Ecuaciones Diferenciales Aplicadas	Electivo tipo A	4	4	0	4
EST600	Ecuaciones Diferenciales Estocásticas	Electivo tipo A	4	4	0	4
ECO822	Teoría Financiera Avanzada	Electivo tipo A	3	3	0	3

*\* Tipo de curso en los planes de estudios de pregrado*

*\*\* En caso de existir agrupaciones de cursos opcionales se debe indicar esta agrupación y los cursos que la conforman.*

**c. Concentración 3: Concentración en Intermediación Financiera Avanzada.** Orientada a profundizar los conocimientos relacionados a la gestión de entidades financieras bajo un enfoque de sostenibilidad.

Clave	Nombre del curso**	Tipo* (Obligatorio/Electivo)	Créditos	Horas		
				H.T.	H.P.	H/ sem
<b>Bloque obligatorio de concentración (6 créditos):</b>						
FIN220 (1FIN47)	Microfinanzas (Finanzas Sostenibles RSU)	Electivo - obligatorio responsabilidad social	3	3	0	3
1FIN31	Regulación Financiera	Electivo de la especialidad	3	3	0	3
<b>Bloque electivo - obligatorio de concentración (3 créditos):</b>						
1FIN44	Machine Learning para Finanzas	Electivo de la especialidad	3	2	2	4
1FIN38 o 1FIN48	Gestión de Riesgo Avanzada (P o SP)	Electivo de la especialidad	3	2	2	4
<b>Bloque electivo (6 créditos mínimo):</b>						
1FIN38 o 1FIN48	Gestión de Riesgo Avanzada (P o SP)	Electivo de la especialidad	3	2	2	4
1FIN44	Machine Learning para Finanzas	Electivo de la especialidad	3	2	2	4
1FIN41	Modelos Actuariales 1	Electivo de la especialidad	3	2	2	4
1FIN42	Modelos Actuariales 2	Electivo de la especialidad	3	2	2	4
1FIN30	Economía Financiera y Bancaria	Electivo de la especialidad	3	3	0	3
FIN222	Tópicos de Econometría Financiera	Electivo de la especialidad	3	2	2	4
1FIN40	Actividad en Finanzas 2	Electivo de la especialidad	1	1	0	1
1FIN23	Actividad en Finanzas 3	Electivo de la especialidad	1	0	2	2
1ECO14	Economía Monetaria	Electivo tipo A	4	4	0	4
1ECO30	Laboratorio de cómputo: Manejo de bases de datos	Electivo tipo A	2	0	3	3
1ECO31	Laboratorio de Econometría: STATA	Electivo tipo A	2	0	3	3
1ECO32	Laboratorio de Econometría: MATLAB	Electivo tipo A	2	0	3	3

1ECO33	Laboratorio de Econometría: Eviews	Electivo tipo A	2	0	3	3
1ECO34	Laboratorio de Econometría: ArcGis	Electivo tipo A	2	0	3	3
1ECO35	Laboratorio de Programación: R y Python	Electivo tipo A	2	0	3	3

*\* Tipo de curso en los planes de estudios de pregrado*

*\*\* En caso de existir agrupaciones de cursos opcionales se debe indicar esta agrupación y los cursos que la conforman.*

**3. Requisitos:** Mínimo de 15 créditos según los requerimientos antes señalados.

**4. Certificaciones:** Otorgadas por la Facultad de Ciencias Sociales

- Concentración en Finanzas Corporativas Avanzada
- Concentración en Inversiones y Actuarial Avanzada
- Concentración en Intermediación Financiera Avanzada

# 7. SUMILLAS

## Cursos obligatorios

### ECO255 – MICROECONOMÍA 1

Es un curso teórico-práctico del núcleo de obligatorios de la especialidad de Economía. Aporta específicamente al desarrollo de las competencias de análisis teórico, análisis cuantitativo y aprendizaje autónomo. En el curso se desarrolla la teoría neoclásica del consumidor y de la firma, a un nivel intermedio, incluyendo los siguientes contenidos principales: los modelos básicos del consumidor y el productor, y extensiones, decisiones inter-temporales, mercados de crédito, teoría de la inversión, el Equilibrio Parcial Competitivo (EPC), análisis de la intervención del Estado y sus efectos sobre el EPC.

### ECO290 – MACROECONOMÍA 1

Curso teórico-práctico del núcleo de obligatorios de la especialidad de Economía. Aporta al desarrollo de las competencias de análisis teórico, análisis cuantitativo y aprendizaje autónomo. En el curso se desarrolla a un nivel intermedio los modelos macroeconómicos de la oferta y demanda agregadas, desde los enfoques clásico y keynesiano. El curso incluye los siguientes capítulos principales: cuentas nacionales y financieras en una economía abierta, el mercado de bienes, el sector público y la política fiscal y monetaria, el modelo IS-LM y el modelo Mundell-Fleming, y políticas macroeconómicas.

### 1FIN18 – FINANZAS CUANTITATIVAS 1

Es un curso teórico-práctico que aporta al dominio de métodos cuantitativos, matemáticos y estadísticos, mediante un enfoque aplicado a problemáticas relevantes de las finanzas. Los tópicos del curso incluyen teoría de funciones y sus aplicaciones en finanzas. Sucesiones y progresiones geométricas y su aplicación a anualidades y perpetuidades. Aproximación de Taylor, convexidad y su aplicación para medir la sensibilidad del precio del bono a su rendimiento. Independencia lineal, sistemas lineales, espacios vectoriales y su aplicación a la generación de carteras delta-gama neutrales. Optimización en varias variables y su aplicación a teoría de portafolio. Teoría de probabilidad, probabilidad condicional y su conexión con la probabilidad de default. Distribuciones de probabilidad comunes: uniforme,

binomial, hipergeométrica y Poisson. Modelo binomial y derivación de la fórmula de Cox-Ross-Rubinstein para precio de opciones.

## **1FIN02 – ANÁLISIS FINANCIERO 1**

Brindar al estudiante los conocimientos necesarios para entender y procesar la información financiera de las organizaciones. Análisis de estados financieros: balance general, estado de ganancias y pérdidas, estado de flujo de caja/efectivo, notas a los estados financieros. Cuentas de orden y contingentes. Interpretación de los principales ratios (liquidez, solvencia, actividad, rentabilidad, valorización). Aplicaciones. Tributación y créditos fiscales, incidencia en la rentabilidad y estabilidad financiera de las empresas. La gestión financiera; costo de capital y valor del dinero, riesgo y rentabilidad, liquidez y solvencia. La técnica presupuestal de las empresas: planeamiento financiero, proyección de los estados financieros; flujos de caja y sistemas de control presupuestal. Administración del capital de trabajo. Gestión de corto plazo (caja, créditos por cobrar e inventarios). Intangibles. Efectos tributarios sobre el Estado de Resultado. Efectos de tipo de cambio sobre los estados financieros. Es recomendable haber aprobado Introducción a las Finanzas (1ECO06) en los Estudios Generales Letras.

## **FIN203 – MICROECONOMÍA FINANCIERA**

Brindar al estudiante los conocimientos necesarios en teoría microeconómica con aplicaciones específicas a las finanzas. Comportamiento del consumidor, empresa y los mercados. Teoría de juegos: juegos estáticas con información completa. Juegos dinámicos con información completa. La teoría del contrato con énfasis en los problemas del riesgo moral y la selección adversa. Los problemas de agencia y estructura de capital.

## **1FIN03 – ANÁLISIS FINANCIERO 2**

Busca que el alumno desarrolle la capacidad de análisis e interpretación de los resultados económicos y financieros de organizaciones dentro de un contexto global. Estándares de Reporte Financieros Internacionales (IFRS y U.S. GAAP). Tópicos de análisis financiero avanzado. Análisis financiero de inversiones: a vencimiento, trading y disponible para la venta. Contabilidad de grupos económicos (inversionistas minoritarios pasivos y activos, joint ventures, inversionistas con control). Vehículos de propósito especial (SPV, SPE). Estados financieros consolidados de empresas multinacionales. Subsidiarias. Traslación cambiaria y moneda funcional.

## **1FIN07 - FINANZAS CORPORATIVAS 1**

EL curso busca desarrollar en el alumno las habilidades necesarias para la evaluación y análisis de proyectos de inversión en un contexto de riesgo. El presupuesto de capital, el apalancamiento y el costo promedio ponderado del capital. El efecto tributario en la estructura de capital óptima. El modelo de valoración de activos (CAPM) para mercados emergentes, los riesgos y beta, la tasa libre de riesgo. El flujo de caja descontado, los flujos relevantes e incrementales. La política de dividendos, el efecto del escudo fiscal, la inversión fija y el valor residual. El capital de trabajo y los gastos pre-operativos. La evaluación de proyectos independientes y mutuamente excluyentes, la evaluación económica y financiera. Análisis de riesgo en proyectos de inversión. La evaluación de proyectos de inversión en MYPES y el análisis de sensibilidad, escenarios y simulación. Principios, objetivos y evaluación de gobernanza corporativa.

## **1FIN27 - FINANZAS INTERNACIONALES**

Dar a los alumnos una comprensión del sistema monetario y financiero internacional y las principales herramientas de política monetaria en el caso peruano. El sistema monetario y financiero internacional. El patrón oro, el acuerdo de Bretton Woods y el sistema de tipos de cambio fijos. La era de los tipos de cambio flexibles. Historia y modelos. Las crisis de deuda en los países en desarrollo. Globalización de los mercados financieros. La Gran Recesión del 2008-2009, causas, consecuencias, rol de la regulación/desregulación. Fundamentos y objetivos de política monetaria. Implementación de política monetaria. Regla de Taylor. Esquema de metas de inflación y mecanismos de transmisión en una economía semi-dolarizada. Respuestas de política monetaria frente a crisis financieras internacionales. Retos para la política monetaria en un contexto globalizado. [Incluye parcialmente temáticas del sílabo del curso de Macroeconomía Monetaria y Financiera del Curso de Finanzas Avanzadas del BCRP.]

## **1FIN04 - FINANZAS CUANTITATIVAS 2**

Es un curso teórico-práctico que aporta al dominio de métodos cuantitativos, mediante un enfoque aplicado. Integrales simples y dobles y distribuciones bivariadas con su aplicación a la distribución conjunta de retornos, valor esperado y varianza de un portafolio. Distribuciones de probabilidad continuas comunes: normal, lognormal, exponencial, chi-cuadrado y beta; el modelo de Black-Scholes de precio de opciones y la derivación de la fórmula de Black-Scholes. Estimación y prueba de hipótesis: distribuciones muestrales, t, chi-cuadrado y F; métodos de estimación y sus propiedades, p-value. Aplicaciones en Backtesting de modelos

VaR. Estimación y prueba de hipótesis en muestras grandes: estimadores consistentes, teorema del límite central, propiedades asintóticas del estimador de máxima verosimilitud. Aplicaciones para estimar el precio de opciones exóticas mediante simulación de Monte Carlo. Caminos aleatorios y cadenas de Markov y sus aplicaciones en riesgo de crédito.

## **FIN210 - FINANZAS CORPORATIVAS 2**

El curso busca desarrollar en el alumno conocimientos de tópicos avanzados en finanzas corporativas. Estructuras de capital complejas y tipos de deuda. Ofertas Públicas de Acciones/Primarias. Políticas de distribución de dividendos. Costo de capital en economías emergentes. Valorización de multinacionales. Valorización de fusiones y adquisiciones (M&A). Leverage Buy-Outs (LBO). Financiamiento de proyectos (Project Finance). Reestructuraciones. Emprendimientos. Opciones reales.

## **1ECO11 - FUNDAMENTOS DE ECONOMETRÍA**

Es un curso teórico-práctico del núcleo de obligatorios de la especialidad de Economía. Aporta al desarrollo de las competencias de análisis cuantitativo, investigación, aprendizaje autónomo, y ética y responsabilidad social. Profundiza en las habilidades estadísticas aprendidas previamente y desarrolla los principales modelos econométricos, desde el modelo de regresión lineal clásico y sus extensiones hasta el modelo de ecuaciones simultáneas a un nivel intermedio. Estos temas se agrupan en los siguientes capítulos principales: modelo clásico de regresión lineal y estimación por mínimos cuadrados ordinarios, el modelo lineal multivariado, propiedades en muestras finitas, estimación con restricciones lineales, selección de modelos, multicolinealidad, pruebas de cambio estructural, variables dummy, estimadores de máxima verosimilitud, propiedades asintóticas, perturbaciones no esféricas: heterocedasticidad y autocorrelación, variables instrumentales, ecuaciones simultáneas; entre otros.

## **1FIN06 - INSTRUMENTOS FINANCIEROS**

Este curso desarrolla las diferentes fuentes de financiamiento que existen en el mercado local e internacional al que pueden recurrir las organizaciones de distinta naturaleza. Marco institucional: los mercados e instituciones financieras. Instrumentos y mecanismos de financiamiento: deuda de corto plazo, financiamiento con proveedores, financiamiento bancario, garantías, deuda de largo plazo, arrendamiento financiero y operativo. Instrumentos de renta fija: emisión de deuda, estructura temporal de tasas de interés, la curva soberana, la valoración y

emisión de bonos, la titulización de activos. Activos estructurados (CDOs, CMOs, MBSs). Instrumentos de renta variable: acciones, el apalancamiento financiero y operativo. Emisión de acciones, la valorización, la política de dividendos y la reinversión de utilidades. Instrumentos alternativos (commodities, activos inmobiliarios, fondos de cobertura, fondos de capital privado).

### **1FIN36 - DERIVADOS FINANCIEROS**

Es un curso teórico-práctico que aporta al dominio de métodos cuantitativos, de valorización de activos, de gestión financiera y de riesgos. Tipos y naturaleza de instrumentos derivados. Mercados centralizados vs OTC. Forwards y futuros: mercados, tipos, valorización bajo no arbitraje. Opciones y swaps: mercados, tipos, valorización bajo no arbitraje. Modelo binomial. Valorización por Black y Scholes (y Merton). Sensibilidades (griegas). Coberturas de tipo de cambio y de tasa de interés. Estrategias básicas de cobertura con opciones. Introducción a opciones exóticas. \*Incluye parcialmente temáticas del sílabo del curso de Derivados Financieros del Curso de Finanzas Avanzadas del BCRP.

### **1FIN37 - EVALUACIÓN PRIVADA Y SOCIAL DE PROYECTOS**

Es un curso teórico-práctico que aporta al dominio de gestión financiera y visión social. Conceptos principales en la evaluación privada de proyectos de inversión e introducción a la evaluación social de proyectos. Estudio y estimación de demanda y oferta. Proyecciones a través de tasas promedio, tendencias y modelos econométricos. Estructura y diseño de perfil de un proyecto de inversión: el flujo de caja. Criterios para evaluación de inversiones: VAN, IR, TIR VAE, PRC. Impactos de inflación, depreciación e impuestos. Análisis de puntos de equilibrio, sensibilidad y riesgo de proyectos. Evaluación del financiamiento y determinación de la estructura óptima de capital. Análisis económico y financiero de proyectos. Análisis de riesgo (Modelo del CAPM, Monte Carlo y Árboles de decisión). El beneficio social y los precios sociales. Perfil de proyectos de inversión pública, contenidos mínimos. La tasa social de descuento y el VAN social.

### **1FIN39 - ACTIVIDAD EN FINANZAS 1: BLOOMBERG**

Es un curso práctico que aporta al dominio de gestión financiera, valorización de activos y asignación y gestión de portafolio. El objetivo del curso es brindar a los alumnos los conocimientos requeridos para el uso y programación en la plataforma de Bloomberg, la plataforma de información dominante en el mundo de las finanzas.

## **FIN214 - ECONOMETRÍA FINANCIERA**

Es un curso teórico-práctico que aporta al dominio de métodos cuantitativos. Brindar al alumno una aproximación a los principales conceptos y metodologías econométricas para el procesamiento e interpretación de bases de datos aplicados a problemáticas relevantes en el mundo de las finanzas. Conceptos de Series de Tiempo (Estacionariedad, No estacionariedad, Otros). Características de series de tiempo financieras. Modelos ARMA. Modelos de Heterocedasticidad Condicional Auto-regresiva (ARCH, GARCH y otros). Modelos de Volatilidad Estocástica. Larga Memoria. Vectores Auto-regresivos. Cointegración. Modelos GARCH multivariados. Modelos de Duración Condicional Auto-regresiva. Modelos de Factores Latentes. Estructura de Plazos de Tasa de Interés. Medidas de Riesgo (VaR, ES, otros) y Teoría de Valores Extremos. Breve Introducción a otros temas: modelos Markov-Switching, Modelos de Transición Suave, Modelos Discretos.

## **1DER07 - DERECHO CORPORATIVO Y FINANCIERO**

El curso busca brindar al estudiante los conocimientos generales de derecho financiero relevantes para la toma de decisiones en el mundo de las finanzas. Agentes que participan en el sistema y derecho financiero peruano. Naturaleza jurídica de la actividad financiera. Conceptos jurídicos sobre normativas financieras, análisis y aplicación de la legislación financiera a fin de efectuar las tareas en esta materia. Conceptos y aplicaciones de tributación aplicables a las finanzas desde la perspectiva del derecho.

## **1FIN08 - ÉTICA PARA LAS FINANZAS**

El curso busca brindar al estudiante los principios y estándares éticos y de conducta profesional esperados en el mundo de las finanzas, de acuerdo a mejores prácticas internacionales. Código de Ética y los siete Estándares de Conducta Profesional de acuerdo al CFA. Estándares Globales de Desempeño en Inversiones (GIPS). Estudios de caso. Código de conducta profesional de Gestores de Patrimonios y Profesionales en Finanzas.

## **1FIN09 - TEORÍA Y GESTIÓN DE PORTAFOLIOS**

El curso busca introducir al estudiante a las teorías clásicas de portafolio, necesarios para la toma de decisiones de financiamiento e inversión. Riesgo e incertidumbre. Elección bajo incertidumbre. Concepto y beneficios de la diversificación de portafolio. Optimización media-varianza. Markowitz. CAPM, beta y portafolio de mercado. El modelo de fijación de precios por arbitraje (APT). Eficiencia de mercado.

Alternativas a los modelos de optimización clásica: resampling y Black-Litterman. La Política de Inversión (Policy Statement). El proceso de asignación de activos (Asset Allocation). Gestión de Portafolios de Renta Fija: benchmarks, estrategias pasivas y activas, metodologías de valor relativo, estrategias combinadas y apalancadas. Gestión de Portafolios de Renta Variable: estrategias pasivas y activas, estrategias tercerizadas, criterios de selección de gestores. Monitoreo y evaluación. Rebalanceo de portafolios. Análisis de desempeño y atribución. Estándares globales de medición de desempeño (GIPS). Es recomendable haber aprobado Instrumentos Financieros (1FIN06).

## **1FIN10 – INTRODUCCIÓN A LA GESTIÓN DE RIESGOS**

El curso busca introducir al estudiante al concepto, identificación, medición y gestión de los principales tipos de riesgo en finanzas (de mercado, crediticio, de liquidez, operacional, entre otros). Desarrolla un marco conceptual para entender la gestión de riesgos en múltiples contextos incluyendo el manejo de portafolios de inversiones y créditos así como el uso de derivados financieros. Para ello desarrolla la metodología de valor en riesgo, los modelos basados en ratings y los modelos de riesgo crediticio en portafolios. Así mismo, introduce conceptos analíticos y técnicas de análisis asociados a la supervisión.

## **1FIN14 – PROGRAMACIÓN EN FINANZAS**

El propósito de este curso es brindar a los alumnos las destrezas computacionales, numéricas y de manejo de grandes bases de datos necesarias en el mundo de las finanzas. Para ese efecto se buscará: (a) desarrollar las destrezas computacionales necesarias de los estudiantes para operar bases de datos grandes, (b) introducir técnicas numéricas relevantes para la ingeniería financiera, (c) desarrollar la capacidad para automatizar procesos ordenados, y (d) presentar y agrupar resultados de manera concreta y efectiva. El contenido de este curso se agrupa en 5 bloques principales: (1) Soluciones por aproximación en Excel: generación de números aleatorios, simulaciones de Montecarlo y diferencias finitas para la valorización y medición del riesgo, (2) Manejo de bases de datos: fusión, agrupación, automatización de bases de datos, (3) Técnicas de predicción supervisada: regresiones estadísticas, (4) Técnicas de predicción no supervisada: componentes principales, agrupamiento de datos, redes neuronales y (5) Big Data: introducción a herramientas para el manejo de bases de datos de volumen elevado.

## **1FIN34 - SEMINARIO DE TESIS EN FINANZAS 1**

Es un seminario de asesoría de tesis de licenciatura que aporta al dominio de metodologías de investigación con aplicación a finanzas. El objetivo del curso es que el estudiante produzca un documento de avance sustancial de la investigación de tesis, a fin de contar con un borrador final de tesis de licenciatura en el siguiente semestre. El trabajo final del curso incluye el marco teórico, o la literatura de referencia, métodos y datos, y el avance de investigación. El trabajo final debe cumplir con los requisitos del Trabajo de Investigación para Bachillerato (TIB).

## **1FIN11 - GESTIÓN BANCARIA**

El curso tiene como objetivo presentar a los participantes los principales elementos de la gestión bancaria y la administración de riesgos en la banca. Funciones de intermediación financiera y rol de la regulación. Estados financieros en una institución financiera. El modelo CAMEL y el análisis de ratios financieros en banca. El manejo de activos y pasivos (ALM). Principales unidades de gestión y criterios de manejo en un banco. Estándares de Basilea (I, II y III). Pruebas de estrés. Riesgo de crédito en carteras mayoristas y en carteras minoristas. Matrices de transición de calificación crediticia de deudores. [Incluye parcialmente temáticas del sílabo de los cursos de Fundamentos de Banca y Tópicos Avanzados de Banca del Curso de Finanzas Avanzadas del BCRP]

## **1FIN35 - SEMINARIO DE TESIS EN FINANZAS 2**

Es un seminario de asesoría de tesis de licenciatura que aporta al dominio de metodologías de investigación con aplicación a finanzas. El producto principal es un borrador final de la tesis de licenciatura, requisito para aprobar el curso.

## **1FIN46 - PRÁCTICAS PRE-PROFESIONALES EN FINANZAS**

Práctica supervisada pre-profesional que aporta al desarrollo de la capacidad de gestionar y resolver problemas y la toma de decisiones en finanzas con visión ética y social. Consiste en realizar una práctica pre-profesional en alguna institución, del sector público o privado, vinculada a su especialidad, con el fin que el estudiante adquiera una primera experiencia en el mercado laboral en que pueda aplicar los conocimientos ya adquiridos en las aulas, así como identificar los requerimientos de este mercado.

# Sumillas de cursos electivos-obligatorios de responsabilidad social

## FIN220 - MICROFINANZAS

Es un curso teórico-práctico que aporta al dominio de gestión e intermediación financiera, perspectiva internacional, y una visión ética y social. Presentar las características fundamentales de las microfinanzas desde una perspectiva de enfoques diversos. Clientes y proveedores de servicios microfinancieros. Servicios microfinancieros: créditos, ahorros, seguros. Fundamentos del análisis de los microcréditos: problemas de riesgo moral y selección adversa. Desempeño de las instituciones de microfinanzas. Comercialización de las microfinanzas (Mission drift). Microfinanzas e inclusión financiera, su impacto, las innovaciones y servicios financieros novedosos desde el sistema formal a raíz de la pandemia. Género y microfinanzas. Rol del estado en las microfinanzas: regulación y supervisión. Casos más exitosos de desarrollo de la actividad microfinanciera a nivel global y regional. \*Sumilla basada parcialmente en Programa Internacional de Especialización en Finanzas y Administración de Riesgos SBS.

## 1FIN47 - FINANZAS SOSTENIBLES

Es un curso teórico-práctico que aporta al dominio de gestión e intermediación financieras y de asignación y gestión de portafolio desde una perspectiva internacional, con visión ética y social. Provee a los estudiantes conocimientos sobre finanzas sostenibles, definidas como estrategias e instrumentos de financiación e inversión que incorporan criterios de sostenibilidad ambiental, social y de gobierno corporativo (ESG en inglés) en la toma de decisiones. Se abordará desde la perspectiva de la corporación moderna y sus diferentes grupos de interés, incluyendo inversionistas, gobierno y sociedad. El curso presenta principios y prácticas de sostenibilidad corporativa (desde la Responsabilidad Social Empresarial hasta el enfoque integrado). Se presentan también estrategias de Inversiones Responsables y Sostenibles, así como instrumentos de finanzas sostenibles (bonos verdes y sociales, entre otros). Todo esto en el marco de iniciativas globales de promoción del desarrollo sostenible y la regulación.

# Electivos dentro de la especialidad

## FIN219 – INSTRUMENTOS DERIVADOS 2

El curso tiene por objetivo preparar al estudiante en la formulación de estrategias de cobertura y de apalancamiento más complejas, así como en su valorización. Valorización de contratos derivados, la exposición de riesgo que éstos representan y las propiedades de estos contratos como instrumentos de cobertura de riesgos. Estrategias direccionales y apalancadas. El curso brinda conceptos teóricos pero se concentra en los aspectos más prácticos y en especial en operaciones típicas de portafolios de inversión.

## FIN222 – TÓPICOS DE ECONOMETRÍA FINANCIERA

Es un curso teórico-práctico que aporta al dominio de métodos cuantitativos. Se presentará al estudiante diversos temas de contenido variable desarrollados recientemente en el campo de la Econometría Financiera con el objetivo de ampliar y profundizar su conocimiento en la materia. Algunos temas son: Modelos de factores latentes, Modelos con Umbrales, Modelos Markov Switching, Modelos de Transición Suave, Cópulas, Medidas de Contagio financiero, Modelos Discretos, Nociones de Econometría Bayesiana, Estimación Bayesiana de Modelos de Volatilidad Estocástica.

## 1FIN19 – ACTIVOS ALTERNATIVOS

El objetivo del curso es brindar al estudiante los conocimientos necesarios para la gestión de activos alternativos como clase de activo invertible. Características y tipos de activos alternativos (bienes raíces, capital de riesgo, fondos de cobertura, activos especulativos, productos estructurados, commodities). Estrategia de inversión por tipo de activo alternativo. Fondos de fondos. Gestión y análisis de riesgo. Valorización: retos y determinantes. Selección de gestores, debida diligencia, medición del desempeño y benchmarking. Se recomienda haber aprobado Instrumentos Financieros (1FIN06).

## 1FIN22 – TÓPICOS AVANZADOS DE RIESGOS

Este curso busca brindar al estudiante conocimientos avanzados en modelación de riesgo. Se desarrollará modelos avanzados de valoración de deuda a partir de la teoría de Black y Scholes, para entender la gestión sofisticada de portafolios sujetos a riesgo de mercado (incluyendo cambiario) y de crédito. Se parte de modelos para procesos de tasa de interés instantánea (short rate) y se continúa con modelos para

la estructura temporal y la volatilidad de las tasas de interés. Exploración de distribuciones estadísticas anidadas y su aplicación a la modelación de riesgos.

### **1FIN23 - ACTIVIDAD EN FINANZAS 3**

Es un curso teórico-práctico que aporta al dominio de métodos cuantitativos y valorización de activos. El objetivo del curso es abordar temas vinculados al aprendizaje de sistemas de información, de programación, al uso práctico de paquetes estadísticos y técnicas cuantitativas en general, o al uso de metodologías aplicadas de valorización de activos o empresas entre otras aplicaciones en finanzas.

### **1FIN24 - PREPARACIÓN PARA CERTIFICACIONES**

El presente curso busca preparar al estudiante para certificaciones internacionales en finanzas definidas por la coordinación de la especialidad.

### **1FIN25 - FINANZAS CUANTITATIVAS AVANZADAS**

Es un curso teórico-práctico que aporta al dominio de métodos cuantitativos, valorización de activos y gestión financiera y de riesgos. Estudiar los modelos financieros estocásticos en tiempo discreto y continuo, con el objetivo de valorar activos financieros. En tiempo discreto, se introducen los conceptos de probabilidad condicional, martingalas, cambio de medida y la derivada de Radon-Nikodym, y sus aplicaciones en el pricing de activos contingentes, incluyendo opciones Europeas y Americanas. En tiempo continuo, se presenta el movimiento Browniano y procesos relacionados, la integral de Ito, la fórmula de Ito, el teorema de la martingala y el teorema de Girsanov, junto con aplicaciones al pricing de opciones Europeas, Americanas y exóticas. Modelos estocásticos para la estructura temporal de las tasas de interés, tales como, Ornstein-Uhlenbeck, Vasicek, CIR, Heath-Jarrow-Morton.

### **1FIN26 - FINANCIAMIENTO DE PROYECTOS PÚBLICO PRIVADOS**

El presente curso tiene por objetivo brindar los fundamentos conceptuales y aplicados necesarios al financiamiento de infraestructura, económica y social, y a la provisión de servicios mediante la modalidad de Asociaciones Público-Privadas (APP), relevante para las políticas públicas. Este es un curso auto inclusivo que parte de la explicación de los conceptos relevantes para entender el objetivo, las características principales y la tipología de APP, tanto bajo buenas prácticas internacionales como en su aplicación al caso peruano. Se presentan los criterios de elección de modalidad de procura: transferencia de riesgos y valor por dinero. Las metodologías para decisión de la modalidad a utilizar (criterios de elegibilidad y comparador público privado). El rol de los actores relevantes: concedente,

concesionario, MEF/ProInversión y reguladores. El proceso de una APP (etapas). Tipos y modelación de riesgos en una APP. Las alternativas de financiamiento: público, corporativo, ¿project finance¿. APP autofinanciadas y cofinanciadas y sus implicancias para el presupuesto público y los usuarios. Hitos constructivos vs. pagos por disponibilidad. Instrumentos y alternativas de financiamiento privado. Participantes. Características, estructuras y tipos de Project finance (BOO, BOT, BOOT, BTO, DBFO).

### **1FIN30 – ECONOMÍA FINANCIERA Y BANCARIA**

El curso tiene como objetivo presentar el instrumental conceptual introductorio de las finanzas desde una perspectiva económica y aplicada a la intermediación financiera y las decisiones de portafolio o inversiones. El curso incluye la introducción a activos, instrumentos financieros y el mercado de capitales. El concepto y modelación de riesgo, la elección bajo incertidumbre y la dominación estocástica. La aversión al riesgo de los agentes y su aplicación en el modelo media-varianza, principal modelo de decisiones de portafolio de inversión. El concepto y aplicación de la diversificación de cartera. El modelo de fijación de precios de activos de capital (CAPM) para valorizar activos de riesgo y su generalización al modelo de fijación de precios por arbitraje (APT). El modelo de equilibrio general para la fijación de precios de activos y los mercados incompletos. Activos derivados y el modelo de BlackScholes para valorizar opciones. Los problemas de información en el mercado de capitales. Instituciones del sistema financiero. Estructura bancaria y financiamiento descentralizado. Introducción a la teoría de la regulación financiera. Este curso no está dirigido a los estudiantes de la especialidad de Finanzas.

### **1FIN31 – REGULACIÓN FINANCIERA**

Brindar al estudiante un conocimiento de los principios y marcos institucionales y normativos de la regulación financiera y del mercado de capitales. La teoría de la regulación prudencial. El Comité de Basilea: supervisión de la administración de los riesgos de mercado y la supervisión consolidada. Ley del sistema financiero y de seguros en el Perú. Ley del Mercado de Valores. La legislación comparada en los sistemas financieros de América Latina.

### **1FIN32 – TEMAS EN FINANZAS 1**

Curso de contenido variable cuya finalidad es presentar las contribuciones recientes en finanzas. Los requisitos serán definidos por la Coordinación de la especialidad de Finanzas en función de los contenidos de cada semestre.

## **1FIN33 – TEMAS EN FINANZAS 2**

Curso de contenido variable cuya finalidad es presentar las contribuciones recientes en finanzas. Los requisitos serán definidos por la Coordinación de la especialidad de Finanzas en función de los contenidos cada semestre.

## **1FIN38 – GESTIÓN DE RIESGO AVANZADA (P)**

Es un curso teórico-práctico que aporta al dominio de métodos cuantitativos y de gestión de riesgos. El curso busca brindar al alumno las herramientas necesarias para la gestión de los principales riesgos financieros: i) Modelos de Riesgo de Crédito (scoring, rating, comportamental y de alertas tempranas); ii) Riesgos Sectoriales; iii) Validación e Implementación de Modelos de Riesgo de Crédito; iv) Riesgo de Modelo; v) Estándares Regulatorios (Basilea II y III) y Contables (NIIF 9); vi) Integración a la gestión (rentabilidad y pricing); vii) Monitoreo y reporting; y, viii) Riesgos de Mercado y Estructurales: Value at Risk, Riesgo de liquidez y ALM (gestión de activos y pasivos).

## **1FIN40 – ACTIVIDAD EN FINANZAS 2**

Es un curso teórico-práctico que aporta al dominio de métodos cuantitativos y valorización de activos. El objetivo del curso es abordar temas vinculados al aprendizaje de sistemas de información, de programación, al uso práctico de paquetes estadísticos y técnicas cuantitativas en general, o al uso de metodologías aplicadas de valorización de activos o empresas entre otras aplicaciones en finanzas.

## **1FIN41 – MODELOS ACTUARIALES 1**

Es un curso teórico-práctico que aporta al dominio de métodos cuantitativos, gestión financiera y gestión de riesgos. El curso tiene la finalidad de introducir a los estudiantes en los aspectos actuariales básicos y necesarios para la tarificación, estimación de reservas técnicas y cuantificación de riesgos técnicos de las empresas que comercializan productos de seguros, tanto de riesgos generales, salud, vida y pensiones. En ese sentido, el contenido de este curso está orientado a velar por la solvencia de las compañías que comercializan estos productos de seguros y pensiones.

## **1FIN42 – MODELOS ACTUARIALES 2**

Es un curso teórico-práctico que aporta al dominio de métodos cuantitativos, gestión financiera y gestión de riesgos. El curso tiene la finalidad de profundizar en los estudiantes técnicas actuariales avanzadas de tarificación, estimación de

reservas técnicas y cuantificación de riesgos de las empresas que comercializan productos de seguros. En ese sentido, el contenido de este curso incorpora modelos lineales generalizados para la tarificación de vehículos, modelos de solvencia basados en riesgo como Solvencia II y técnicas de mitigación de riesgos como el reaseguro, así como medidas de rentabilidad de seguros de largo plazo, tanto para seguros de riesgos generales y salud como de vida y pensiones.

### **1FIN43 - FINANZAS CONDUCTUALES Y EXPERIMENTALES**

Es un curso teórico-práctico que aporta al dominio de métodos cuantitativos, valorización de activos, gestión financiera y asignación y gestión de portafolio. Desarrolla los temas de la economía del comportamiento y experimental más relevantes para el área de finanzas, así como temas propios de las finanzas conductuales. Se revisan el modelo de homo economicus y de mercados eficientes, se presentan los sesgos y heurísticas, teoría prospectiva, descuento hiperbólico y contabilidad mental. Desde la perspectiva conductual, se estudian los temas de arbitraje, precio de activos, finanzas corporativas, y teoría de portafolio. Principios de economía experimental, experimentos clásicos en finanzas, técnicas econométricas para el análisis de datos experimentales.

### **1FIN44 - MACHINE LEARNING PARA FINANZAS**

Es un curso teórico-práctico que aporta al dominio de métodos cuantitativos, de gestión e intermediación financiera y de riesgos. Brinda al alumno herramientas para comprender y aplicar algoritmos de Machine Learning: i) Data sampling, data analysis, data pre-processing y feature engineering; ii) ML y Statistical Learning: Error Metrics, Error Reducible-Irreducible, Bias vs Variance, Overfit vs Underfit, Paramétrico vs No paramétrico; iii) Train, Test, Validations, Cross-Validation, Resampling, Bootstrapping; iv) Tipos de aprendizaje: Supervised, Unsupervised, Reinforcement, Semi-supervised, Self-supervised Learning; v) Métricas de clasificación y orden (precision, recall, specificity, accuracy, f1, ROC, AUC, MAP@K) y métricas de regresión ( $R^2$ , MAE, RMSE, AIC, BIC); vi) Modelos: Logistic, Random Forest, Gradient Boosting, Support Vector Machine; vii) Métricas de distancia: Euclidea, Manhattan, etc.; viii) Reducción de dimensionalidad: Mediante descomposición lineal (PCA y SVD); ix) Clustering: Flat (k-Means) y jerárquico (con distintos tipos de linkage); x) Modelos: Neural Networks.

## **1FIN45 - PRIVATE EQUITY, VENTURE CAPITAL Y FINTECH**

Es un curso teórico-práctico que aporta al dominio de valorización de activos, de gestión e intermediación financiera y de asignación y gestión de portafolio desde una perspectiva internacional. El curso tiene por objetivo brindar al estudiante conocimientos sobre las alternativas de financiamiento a través de private equity (PE o capital privado) y venture capital (VC o capital de riesgo), así como del rol de la innovación y tecnología financiera (FinTech) en el financiamiento de VC, el impulso a emprendimientos y la provisión de servicios financieros. Los fundamentos y la industria de PE y VC. Características y tipos de participación: modalidades de deuda y de capital. Selección de gestores, due diligence, valorización y medición de desempeño. Creación de valor y salida.

## **1FIN48 - GESTIÓN DE RIESGO AVANZADA (SP)**

Es un curso teórico-práctico que aporta al dominio de métodos cuantitativos y de gestión de riesgos. El curso busca brindar al alumno las herramientas necesarias para la gestión de los principales riesgos financieros: i) Modelos de Riesgo de Crédito (scoring, rating, comportamental y de alertas tempranas); ii) Riesgos Sectoriales; iii) Validación e Implementación de Modelos de Riesgo de Crédito; iv) Riesgo de Modelo; v) Estándares Regulatorios (Basilea II y III) y Contables (NIIF 9); vi) Integración a la gestión (rentabilidad y pricing); vii) Monitoreo y reporting; y, viii) Riesgos de Mercado y Estructurales: Value at Risk, Riesgo de liquidez y ALM (gestión de activos y pasivos).

# **Electivos tipo A**

## **1ECO14 - ECONOMÍA MONETARIA**

Es un curso teórico del subgrupo de alterno obligatorios de la especialidad de Economía. Aporta al desarrollo de las competencias de análisis teórico, análisis cuantitativo y aprendizaje autónomo. Sus contenidos principales son: definiciones y funciones del dinero, el proceso de creación de dinero y su relación con el déficit público; el diseño de la política monetaria con tipo de cambio fijo y tipo de cambio flexible en economías cerradas y abiertas; los mecanismos de transmisión de la política monetaria, el rol de la tasa de interés, el tipo de cambio, y los mercados financieros y la inflación; el dinero y la balanza de pagos; los flujos de capitales, el crédito y la regulación macro-prudencial, los mecanismos de transmisión de la política monetaria en el Perú; modelos de crisis de balanza de pagos.

## **ECO381 – TEORÍA DE LA REGULACIÓN**

Es un curso electivo avanzado de la especialidad de Economía. Aporta al desarrollo de las competencias análisis teórico y aprendizaje autónomo. El curso estudia el análisis de las políticas regulatorias implementadas en industrias con segmentos caracterizados como monopolios naturales. El contenido del curso incluye los problemas de información asimétrica, las fallas de mercado y la intervención del Estado, regulación de monopolios naturales, competencia por el mercado, antitrust, diseño regulatorio, economía política de la regulación, entre otros.

## **1ECO43 – TEORÍA DE JUEGOS**

Es un curso electivo teórico y práctico de la especialidad de Economía. Aporta al desarrollo de las competencias de análisis cuantitativo y aprendizaje autónomo. El curso desarrolla los temas básicos de la teoría de juegos de manera formal y ve sus aplicaciones a la economía. El contenido del curso incluye juegos cooperativos y juegos no cooperativos estáticos y dinámicos, con y sin información completa. Para cada caso, se estudian los conceptos de solución relevantes y se presentan aplicaciones a las diversas áreas de la economía.

## **1ECO15 – ORGANIZACIÓN INDUSTRIAL**

Es un curso teórico del subgrupo de alterno obligatorios de la especialidad de Economía. Aporta específicamente al desarrollo de las competencias de análisis teórico y aprendizaje autónomo. Presenta las teorías contemporáneas de la empresa y modelos económicos de mercados e industrias con distintas estructuras y configuraciones, identificando las condiciones en las que surgen la competencia efectiva y el poder de mercado, y sus consecuencias en términos de eficiencia, bienestar y desarrollo. Estos temas se agrupan en los siguientes capítulos principales: firma, monopolios y bienestar, discriminación de precios, controles verticales, oligopolios, estrategia y colusión, carteles y barreras a la competencia, políticas antitrust, innovación, mercados de dos lados, entre otros.

## **1ECO37 – EVALUACIÓN SOCIAL DE PROYECTOS**

Es un curso electivo avanzado y de orientación profesional de la especialidad de Economía. Aporta al desarrollo de las competencias de aprendizaje autónomo, comunicación, y ética y responsabilidad social. El curso presenta las herramientas de análisis y prácticas gubernamentales detrás de las decisiones de inversión pública. Temas principales para cubrir son metodologías de análisis costo beneficio y evaluación de proyectos públicos, el proceso de programación de la inversión

pública, innovaciones en la gestión pública por resultados, dilemas éticos en la evaluación social de proyectos, entre otros.

### **1ECO30 - LABORATORIO DE CÓMPUTO: MANEJO DE BASES DE DATOS**

Es un laboratorio informático del subgrupo de alterno obligatorios de la especialidad de Economía. Aporta al desarrollo de las competencias de análisis cuantitativo y aprendizaje autónomo. El curso busca proporcionar herramientas para aplicaciones estadísticas y el uso de técnicas a través del conocimiento de diversas bases de datos nacionales e internacionales.

### **1ECO31 - LABORATORIO DE ECONOMETRÍA: STATA**

Es un laboratorio informático del subgrupo de alterno obligatorios de la especialidad de Economía. Aporta al desarrollo de las competencias de análisis cuantitativo y aprendizaje autónomo. Instruye herramientas para aplicaciones estadísticas y el uso de técnicas econométricas más importantes del análisis de datos mediante el manejo de Stata. Los temas se agrupan en los siguientes capítulos: introducción al lenguaje de la programación, manejo de bases de datos, macros y loops, visualización de datos y mapas, test paramétricos y análisis de regresión lineal, modelos de elección discreta, entre otros.

### **1ECO32 - LABORATORIO DE ECONOMETRÍA: MATLAB**

Es un laboratorio informático del subgrupo de alterno obligatorios de la especialidad de Economía. Aporta al desarrollo de las competencias de análisis cuantitativo y aprendizaje autónomo. El curso busca proporcionar herramientas para aplicaciones estadísticas y el uso de técnicas econométricas más importantes del análisis de datos mediante el manejo de Matlab. Los temas se agrupan en los siguientes capítulos: elementos del lenguaje MATLAB, el sistema MATLAB, los M-file script y función, representación gráfica y visualización de datos en 2 y 3 dimensiones, diseño e implementación de algoritmos numéricos, entre otros.

### **1ECO33 - LABORATORIO DE ECONOMETRÍA: EVIEWS**

Es un laboratorio informático del subgrupo de alterno obligatorios de la especialidad de Economía. Aporta al desarrollo de las competencias de análisis cuantitativo y aprendizaje autónomo. Ofrece herramientas para aplicaciones estadísticas y el uso de técnicas econométricas más importantes del análisis de datos mediante el manejo de Eviews. Los temas se agrupan en los siguientes capítulos: el modelo lineal econométrico, análisis de series de tiempo estacionarias y no estacionarias, variables instrumentales, modelos determinísticos y estocásticos, entre otros.

## **1ECO34 - LABORATORIO DE ECONOMETRÍA: ARCGIS**

Es un laboratorio informático del subgrupo de alterno obligatorios de la especialidad de Economía. Aporta específicamente al desarrollo de las competencias de análisis cuantitativo y aprendizaje autónomo. Introduce a los estudiantes a los principios básicos de los sistemas de información geográfica (SIG) a través del uso del software ArcGIS. Los temas se agrupan en los siguientes capítulos: introducción a los sistemas de información geográfica (SIG), interfaz SIG, georreferenciación, generación de entidades vectoriales, herramientas de geoprocésamiento, interpolaciones y modelos de elevación digital, entre otros.

## **1ECO35 - LABORATORIO DE PROGRAMACIÓN: R Y PYTHON**

Es un laboratorio informático del subgrupo de alterno obligatorios de la especialidad de Economía. Aporta al desarrollo de las competencias de análisis cuantitativo y aprendizaje autónomo. Presenta los principios básicos de la programación a través del uso de R y Python. Los temas se agrupan en los siguientes capítulos: introducción al lenguaje de la programación, utilización del lenguaje, creación de datos, secuencias e iteración, simulación, files y outputs, entre otros.

## **POL245 - DERECHO INTERNACIONAL PÚBLICO**

El curso empieza por abordar el marco jurídico internacional que regula la mayor parte de las transacciones que trascienden las fronteras nacionales, incluyendo los conceptos, perspectivas, fuentes y sujetos del derecho internacional contemporáneo. Aborda luego la evolución reciente de esta disciplina, que ya no se limita a regular las relaciones entre Estados, sino que además pretende regular en forma creciente procesos que tienen lugar dentro de las fronteras del Estado-nación. Además del derecho positivo, el curso pretende familiarizar a los estudiantes con los debates normativos que estuvieron en el origen (y que continúan siendo relevantes) para esta disciplina (por ejemplo, el caso del derecho internacional humanitario).

## **POL238 - TEORÍA DEL ESTADO**

En este curso se analizarán los principales enfoques teóricos producidos desde la disciplina sobre el Estado. Se examinan los diferentes caminos de formación y construcción de los Estados, el desarrollo de sus instituciones, sus relaciones con la sociedad y su ubicación en el sistema mundial. Se analizarán esquemas marxistas, pluralistas e institucionalistas del Estado, así como las características centrales de los Estados contemporáneos, considerando temas como los Estados de bienestar, el

corporativismo, el desafío de los movimientos sociales, los grupos de interés, la influencia de diversas redes informales de política y la apertura del Estado a formas de participación ciudadana; grados y niveles de autonomía de los Estados frente a la sociedad; la existencia de instituciones formales e informales, así como otros temas específicamente referidos a los Estados latinoamericanos. Estas discusiones se ilustrarán con ejemplos de temas y problemas de investigación pertinentes para el caso peruano.

## **1POL01 - POLÍTICAS PÚBLICAS**

El curso parte de un enfoque decisional de las políticas públicas y revisa los modelos teórico sobre formulación de políticas públicas. Se discuten sus tipologías, el ciclo de política (establecimiento de agenda, diseño, implementación y evaluación de políticas). Se desarrollan técnicas para el análisis de políticas tales como mapeo de actores, estructuración de problemas públicos, selección de alternativas y articulación de políticas. El curso incluye una discusión técnico - operativa sobre el diseño e implementación de políticas y se desarrollan temas sectoriales económicos, sociales y culturales. También se desarrollan temas como bienes públicos, bienes globales y transferencia de políticas, así como el papel de las organizaciones de la sociedad civil, del mercado y de los ciudadanos en la formulación y accountability de las políticas públicas.

## **1POL02 - GESTIÓN PÚBLICA**

El curso se centra en el desarrollo de conocimiento académico y profesional sobre la administración pública. Paradigmas pre y post burocráticos. La gestión pública como organización y generación de valor. El enfoque estratégico en las decisiones gerenciales. El planeamiento estratégico y su metodología. Eficacia, calidad y rendimiento de las habilidades directivas. Nuevas técnicas de gestión por procesos, de mejora continua y coordinación en las organizaciones públicas. Sistemas administrativos y servicio público. Enfoque institucional. Costos de transacción y producción. Las nociones de bienes públicos, privados y cogestionables. Fallas de mercado, de gobierno, externalidades e intervención estatal. Los enfoques de la elección racional y la operacionalización de las decisiones en la gestión pública.

## **1REI01 - TEORÍA DE LAS RELACIONES INTERNACIONALES 1**

Curso teórico práctico. El curso incorpora el estudio de las relaciones internacionales desde la aparición de la disciplina en los años 1920 e incluye una revisión del pensamiento internacional anterior a 1900. El curso pretende ser una introducción general a las distintas perspectivas teóricas (realismo, liberalismo, constructivismo,

etc.) y a los principales temas (regímenes internacionales, economía política internacional, seguridad internacional, política exterior comparada, nueva agenda internacional) que incluye la disciplina.

## **1REI02 - HISTORIA DE LAS RELACIONES INTERNACIONALES**

Curso teórico. El curso está diseñado para desarrollar una comprensión global de los procesos históricos desde la perspectiva de las relaciones internacionales desde la Paz de Westfalia hasta la segunda guerra mundial. Adicionando elementos de la historia diplomática y de política exterior. Así mismo, resalta los paralelismos y los procesos comunes a todas las regiones, de modo que los fenómenos políticos, económicos, sociales y culturales ¿con todos sus cambios y permanencias¿ puedan ser analizados desde la óptica de las relaciones internacionales y los órdenes mundiales.

## **GES208 - TEORÍA ORGANIZACIONAL**

Es un curso teórico-práctico que pertenece al eje de Estrategia e Innovación. Permite a los y las estudiantes ser capaces de utilizar las teorías para plantear una interpretación de casos organizacionales complejos, y entender la importancia de la base teórica para alcanzar una comprensión profunda de la realidad organizacional. El curso aborda el concepto de teoría y ciencia, así como los principales marcos conceptuales de la teoría organizacional y su evolución hasta la actualidad, promoviendo la reflexión y el pensamiento crítico respecto de textos de autor.

## **GES232 - GESTIÓN ESTRATÉGICA**

Es un curso capstone de naturaleza teórico-práctica que pertenece al eje de Estrategia e Innovación. Permite a los y las estudiantes comprender y aplicar los conceptos, y las herramientas para generar estrategias que creen valor en diferentes tipos de organizaciones a partir del desarrollo de un diagnóstico integral de la organización y de su contexto, así como de consideraciones para favorecer su sostenibilidad. En el curso se abordan temas como la estrategia, visión sistémica y generación de valor, el análisis estratégico y la propuesta estratégica (formulación), la implementación y evaluación estratégica. Concluyendo con el diseño del modelo de gestión estratégica.

## **GES235 - PLAN DE NEGOCIOS**

Este curso capstone es de naturaleza teórico-práctico y pertenece al eje de Estrategia e Innovación. Permite a los y las estudiantes comprender y aplicar las principales herramientas y métodos para desarrollar un proyecto de

emprendimiento desde cero, y comunicar la propuesta a diferentes públicos en distintos formatos. A través de cada una de las sesiones, diseñarán un modelo de negocio innovador a partir de la identificación de una necesidad en el mercado y el diseño de una propuesta de valor deseable, factible y viable. Este curso se desarrolla en la etapa final de la carrera de gestión, constituyéndose en una oportunidad para integrar los conocimientos adquiridos en cursos previos de estrategia, marketing, operaciones, personas y finanzas, que son necesarios para el desarrollo de un modelo de negocio.

### **CON286 - TRIBUTACIÓN CONTABLE 1**

Es un curso teórico práctico que aporta al conocimiento de las normas y obligaciones tributarias con relación al impuesto a la renta considerando el efecto contable de las operaciones. El curso aporta a las siguientes dos competencias: (i) determina las obligaciones tributarias formales y sustanciales sobre la base del marco normativo correspondiente, y evalúa el riesgo fiscal de una organización; y, (ii) actúa con responsabilidad ética y ciudadana, reconociendo y respetando la diversidad, la autonomía y la dignidad de los demás. Ello, a través de los siguientes temas: el estudio del impuesto a la renta de personas naturales y de la renta empresarial, desde un punto de vista tributario y contable, en relación con las Normas Internacionales de Información Financiera (NIIF) y el efecto en los estados financieros de una entidad, mediante una metodología pedagógica activo-colaborativa con el apoyo de herramientas informáticas.

### **CON297 - EVALUACIÓN DE LA INFORMACIÓN FINANCIERA**

Es un curso teórico práctico orientado al análisis y evaluación de la información financiera de una organización para evaluar su situación financiera. En esta medida el curso contribuye a las siguientes dos competencias: (i) elabora y evalúa la información financiera de una organización para la toma de decisiones de los grupos de interés; e, (ii) investiga y desarrolla sus conocimientos sobre temas profesionales y académicos de manera crítica, autónoma, reflexiva y creativa y presenta formalmente sus resultados. Ello, a través de los siguientes temas: métodos y técnicas aplicables al análisis de la situación financiera y económica de la entidad, así como de las tendencias de los sectores económicos en que actúa, a fin de ofrecer alternativas y escenarios a los directivos para la toma de decisiones, mediante el empleo de una metodología pedagógica activo-colaborativo con el apoyo de herramientas digitales.

## **MAT600 - FUNDAMENTOS DE ANÁLISIS REAL**

Espacios métricos y espacios normados. Análisis lineal entre espacios normados. Diferenciabilidad de funciones. Espacios de producto interno. Series. Correspondencias.

## **MAT799 - ÁLGEBRA LINEAL NUMÉRICA**

Espacios vectoriales. Transformaciones lineales y matrices. Determinantes. Cambio de base. Autovalores, autovectores y similaridad. Equivalencia unitaria y matrices normales. Teorema de triangularización unitaria de Schur. Formas canónicas. La forma canónica de Jordan. Matrices hermitianas y simétricas. Normas de vectores y matrices. Matrices positivo definidas. Descomposición en valores singulares. Algoritmos. Soluciones numéricas de sistemas lineales. Soluciones de mínimos-cuadrados para sistemas lineales. El problema numérico de autovalores matriciales.

## **MAT833 - MEDIDA Y PROBABILIDAD**

El estudiante manejará las herramientas básicas de la teoría de la medida y tendrá habilidades para la construcción de modelos y la solución de problemas en la teoría de probabilidad. Los temas que se abordarán se centran en: espacio medible: sigma álgebra, borelianos, medidas y medidas de probabilidad. Medida de Lebesgue. Primer lema de Borel-Cantelli. Funciones medibles, variables y vectores aleatorios. Distribuciones. Integral de Lebesgue, teorema de la convergencia monótona y lema de Fatou. Teorema de Radon-Nikodym. Esperanza y variancia de variables aleatorias. Medidas producto e independencia. Distribuciones. Función característica. Espacios LP y convergencia de variables aleatorias. Convergencia en casi todo punto. Convergencia en probabilidad. Convergencia en distribución.

## **EST621 - PROCESOS ESTOCÁSTICOS**

Procesos estocásticos de estado y tiempo discretos. Paseo aleatorio. Teoría de renovación. Procesos estocásticos de estado discreto y tiempo continuo. Procesos estocásticos de estado y tiempo continuos. Procesos puntuales. Procesos estacionarios. Cálculo estocástico. Procesos de ramificación.

## **MAT693 - CONCAVIDAD Y OPTIMIZACIÓN**

Introducción. Conjuntos convexos y algunas propiedades. Teorema de separación. Introducción a la programación no lineal. Programación convexa. Punto silla. El teorema de Kuhn-Tucker. Caracterización por las condiciones de primer orden. Teorema de Lagrange. Aplicaciones. Análisis de sensibilidad.

## **MAT834 - ECUACIONES DEFERENCIALES APLICADAS**

El alumno será capaz de implementar numéricamente la solución de ecuaciones diferenciales ordinarias y parciales en una y dos dimensiones. Así como será capaz de discriminar entre varios métodos numéricos para elegir el más adecuado según el problema a resolver. La temática que se desarrollará se centra en: Problemas de valor inicial y de frontera. Método de diferencias finitas. Métodos para resolver la ecuación advección- difusión. Discretización del laplaciano. Aplicación de la transformada de Fourier. Esquemas de intervalo en el tiempo y el espacio. Ecuación del calor en una y dos dimensiones. Discretización de la ecuación de la onda. EDPs de orden más alto y estabilidad. Optimización del rendimiento computacional. Métodos espectrales. La transformada de Chevychev. Técnicas pseudoespectrales con filtraje. Técnicas de descomposición de operadores. La ecuación no lineal de Schrodinger.

## **EST600 - ECUACIONES DEFERENCIALES ESTOCÁSTICOS**

Teorema de existencia y unicidad para ecuaciones diferenciales estocásticas. Soluciones débiles y soluciones fuertes. Difusión. Propiedad markoviana. Propiedad fuerte de Markov. Generador de una difusión. Fórmula de Dynkin. El operador característica. Ecuación de Kolmogorov hacia atrás. Fórmula de Feynman-Kac. El problema martingala. El teorema de Girsanov. Control estocástico. Ecuación de Halmiton-Jacobi-Bellman. Controles markovianos versus controles adaptativos generales.

## **ECO822 - TEORÍA FINANCIERA AVANZADA**

El objetivo del curso es proveer a los alumnos de los fundamentos de la teoría de las finanzas avanzadas: Arbitraje, Equilibrio y Asset Pricing: el mercado y el portafolio: el arbitraje y los mercados completos, la valoración y los comportamientos óptimos, el equilibrio con mercados financieros. Teoría del Portafolio: los métodos de optimización de portafolios, la teoría de la decisión, la teoría inter temporal del portafolio, la asignación estratégica de activos, las implicancias del aprendizaje y los modelos erróneos en la selección de portafolios. Finanzas Internacionales: el asset pricing internacional, el equilibrio general internacional con mercados incompletos, los modelos de estructura temporal de la tasa de interés, el enfoque de Heath, Jarrow y Morton, los modelos de valuación de divisas, los riesgos de crédito, los bonos riesgosos y los swaps de tasas de interés, el riesgo país.



**PUCP**

Facultad de  
Ciencias Sociales

—  
Especialidad de  
Finanzas

# Visita nuestras redes sociales:

---



**@SocialesPUCP**