

## **Cursos – Especialidad de Finanzas 2025-0**

### **Sílabos (2024-1 o 2024-2)**

<https://drive.google.com/drive/folders/1aa4OXBqXn8h6GCXQynUmJqcN0pODy2Zp?usp=sharing>

### **Curso: 1FIN19 Activos Alternativos**

- Profesor: Aaron Zambrano, CFA, ESG
- Créditos: 3.00
- Modalidad: presencial
- Requisito(s): 1FIN50 o 1FIN55 Finanzas Corporativas 1 (SP o P)
- Horario: lunes y martes 06:00 – 09:00 pm.

### **Descripción del curso**

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).

### **Reseña del docente**

Aaron Zambrano es Ingeniero de Sistemas de la Universidad de Lima y con una maestría en Administración de negocios en The Fuqua School of Business - Duke University. Además de tener la certificación de CFA Charterholder y de inversiones en ESG del CFA Institute, y del curso extensión de finanzas avanzadas del Banco Central de Reserva del Perú.

Tiene más de 12 años de experiencia en el sistema financiero y de inversiones local e internacional. Actualmente se desempeña como Vicepresidente senior del fondo de inversión privada con enfoque en infraestructura de la región andina de AC Capitales. Su responsabilidad recae en la originación, ejecución y manejo de las inversiones del fondo de infraestructura. Antes, trabajó como banquero de inversión en Bank of America Merrill Lynch en Nueva York cubriendo la región latinoamericana y como administrador de portafolios de inversión en renta fija y acciones para la región andina de Credicorp Capital.

## **Curso: 1FIN44 Machine Learning para Finanzas**

- Profesor: Nadia Valderrama
- Créditos: 3.00
- Modalidad: virtual (dictado desde España)
- Requisito(s): 1FIN14 Programación en Finanzas y FIN214 Econometría Financiera (Finanzas). 1ECO11 Fundamentos de Econometría y 1ECO35 Laboratorio de Programación: R y Python o 1FIN14 Programación en Finanzas (Economía).
- Horario: viernes 01:00 – 04:00 pm y sábado 09:00 am – 12:00 m

### **Descripción del curso**

Es un curso teórico con aplicaciones prácticas 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 a problemas financieros. Entre los tópicos a considerar se incluyen data sampling, data analysis, data pre-processing y feature engineering; statistical learning; train, test, validation, cross-validation, resampling y bootstrapping; aprendizaje supervised y unsupervised; tipología de modelos (logistic, decision tree, random forest, gradient boosting, support vector machine y neural networks; métricas de clasificación y regresión; técnicas de reducción de dimensionalidad y clustering. Las aplicaciones prácticas abordan conceptos fundamentales de finanzas.

### **Reseña del docente**

Nadia Valderrama es Ingeniera Economista de la Universidad Nacional de Ingeniería con amplia experiencia en el ámbito financiero, desempeñándose en instituciones públicas y privadas con alcance nacional e internacional. Se encuentra cursando el Doctorado en Economía y Gestión de la Innovación impartido en coordinación por las universidades Autónoma, Complutense y Politécnica de Madrid. Cuenta con un Máster en Big Data Science de la Universidad de Navarra y un Máster en Finanzas dictado conjuntamente por CENTRUM PUCP y EADA (Escuela de Alta Dirección y Administración).

Actualmente es Manager en el Área de Global Risk Management – Unidad de Data & Advanced Analytics en BBVA (Madrid, España), siendo parte del equipo de Riesgo de Crédito en el que lidera proyectos de desarrollo e implantación de modelos y parámetros. Antes, fue responsable de equipos enfocados en la gestión de Portafolio de la Banca Empresas y Corporativa, y la Estrategia de Riesgos en BBVA Perú. Previamente formó parte de la Unidad de Riesgos de Mercado de la Corporación Financiera de Desarrollo (COFIDE).

Sus áreas de interés son la gestión de riesgos financieros, la inteligencia artificial, la sostenibilidad e innovación empresarial y las políticas públicas de transformación digital sectoriales.

### **Curso: 1FIN02 Análisis Financiero 1**

- Profesor: Andrés García
- Créditos: 4
- Modalidad: presencial
- Requisito(s): 60.00 créditos aprobados totales.
- Horario:

Clase: martes y jueves 03:00 – 06:00 pm.

Prácticas: miércoles y viernes 04:00 – 06:00 pm.

### **Descripción del curso**

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.

### **Reseña del docente**

Andrés García es Economista Licenciado de la Pontificia Universidad Católica del Perú; además, tiene un MBA por la IPADE - México.

Cuenta con más de treinta años de experiencia laboral. Actualmente se desempeña como director propietario de Food Service Consulting ([www.foodserviceconsulting.com.pe](http://www.foodserviceconsulting.com.pe)) la

primera consultora de asesoría gastronómica de Lima. Es Investigador Asociado del Instituto del Futuro ([www.idf.pe](http://www.idf.pe)); miembro externo del Consejo Consultivo de la Facultad de Administración de la Universidad San Ignacio de Loyola y Consultor externo de Fondecyt y el Banco Mundial de la cadena de alimentos saludables Thika Thani Market. Ha sido presidente de la Asociación de Instituciones Educativas Católicas (AIEC) del arzobispado de Lima; laboró como Gerente de la Sede y CFO de Campus Lima la Universidad de Piura; ocupó el cargo de CFO de la cadena de fast food BEMBOS y NGR por cerca de 14 años y Gerente General de Tubos y Perfiles Metalicos (TUPEMESA). Asesor externo de empresas del sector gastronómico y de retail de calzado de moda.

Es docente en ESAN, PUCP, UPC y USIL a nivel de pre y post grado.

### **Curso: 1FIN39 (0721) Actividad en Finanzas 1: Bloomberg**

- Jefe de práctica: Anthony López, CAIA
- Créditos: 1
- Modalidad: presencial
- Requisito(s): 30.00 créditos aprobados en Facultad (Finanzas). 1FIN02 Análisis Financiero 1 y EST214 Estadística Inferencial (Economía).
- Horario: lunes y martes 06:00 – 08:00 pm.

### **Descripción del curso**

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.

### **Reseña del jefe de práctica**

Anthony López es bachiller en Ingeniería Industrial por la PUCP. Ha aprobado el CAIA Program y el nivel II del CFA Program.

Actualmente es Associate en Vicctus, Multi-Family Office de Credicorp Capital y jefe de práctica de la especialidad de Finanzas en la PUCP. Antes se desempeñó en la Bolsa de Valores de Lima en los equipos de Desarrollo de Proyectos, Productos y Planeamiento. Ha sido el confundador de Atix Capital y cuenta con la certificación CAIA.

### **Curso: 1FIN39 (0722) Actividad en Finanzas 1: Bloomberg**

- Jefe de práctica: Diego Torres
- Créditos: 1
- Modalidad: presencial
- Requisito(s): 30.00 créditos aprobados en Facultad (Finanzas). 1FIN02 Análisis Financiero 1 y EST214 Estadística Inferencial (Economía).
- Horario: jueves 06:00 – 08:00 pm y sábado 10:00 am – 12:00 m.

### **Descripción del curso**

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.

### **Reseña del jefe de práctica**

Diego Torres es bachiller de la especialidad de Finanzas por la PUCP. Actualmente labora en Credicorp Capital como Analista de Renta Fija y FX gestionando el portafolio de Renta Fija Internacional y la posición spot y forwards en USDPEN. Anteriormente, estuvo en la Mesa de Inversiones de Pacífico Seguros.

En el ámbito académico, dictó el curso de Actividad en Finanzas 1: Bloomberg.

### **Curso: 1FIN39 (0723) Actividad en Finanzas 1: Bloomberg**

- Jefe de práctica: Andrea Martinez
- Créditos: 1

- Modalidad: presencial
- Requisito(s): 30.00 créditos aprobados en Facultad (Finanzas). 1FIN02 Análisis Financiero 1 y EST214 Estadística Inferencial (Economía).
- Horario: miércoles y viernes 06:00 – 08:00 pm.

### **Descripción del curso**

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.

### **Reseña del jefe de práctica**

Andrea Martinez es Bachiller en Economía por la PUCP, con experiencia en el sector financiero y académico. Obtuvo el segundo puesto en el Programa de Especialización en Mercado de Valores de la Superintendencia del Mercado de Valores.

Actualmente es Analista de Riesgos Financieros II en la Superintendencia del Mercado de Valores, con experiencia previa en la Vicepresidencia de Control de Riesgos en Banbif. También se ha desempeñado como jefe de prácticas en los cursos de Economía General y Actividad en Finanzas 1: Bloomberg.

### **Dirección de Finanzas**