

TEMARIOS

CONVOCATORIA PÚBLICA DIRIGIDA A TODO (A) INTERESADO (A) QUE DESEE
INGRESAR AL SERVICIO PROFESIONAL DE CARRERA
NO. CNBV-004-2015

Nombre de la Plaza:	Subdirector (a) de Entidades e Intermediarios Bursátiles	
No. de Concurso:	63944	
Consecutivo:	3881	
Área de adscripción:	Dirección General de Supervisión de Entidades e Intermediarios Bursátiles	
Tema1:	Regulación de los Mercados de Valores y Derivados	
	Subtema1:	Autoridades y Facultades
		Bibliografía
		Ley de la Comisión Nacional Bancaria y de Valores. (Publicada en el Diario Oficial de la Federación el 28 de abril de 1995. Actualizada con las modificaciones del Decreto publicado en el propio Diario el 9 de abril de 2012)
		Títulos, preceptos y/o Epígrafes
		Título Primero Capítulo I (De la Naturaleza y Objeto) Capítulo II (De las Facultades) Título Segundo Capítulo I (De las Bases de Organización) Capítulo II (De la Junta de Gobierno)
		Reglamento Interior de la Comisión Nacional Bancaria y de Valores. (Publicado en el Diario Oficial de la Federación el 12 de agosto de 2009. Actualizado con las reformas publicadas en el propio Diario el 23 de abril y 30 de noviembre de 2012)
		Título Primero (De las Disposiciones Preliminares) Capítulo Único



“2015, Año del Generalísimo José María Morelos y Pavón”

		Página Web
		www.cnbv.gob.mx
	Subtema2:	Entidades Bursátiles (Bolsas, Contrapartes Centrales, Cámaras de Compensación, Proveedores de Precios, Organismos Autorregulatorios, Sociedades que administran sistemas para facilitar operaciones con valores, Instituciones para el Depósito de Valores, entre otros.)
		Bibliografía
		Ley del Mercado de Valores. (Publicada en el Diario Oficial de la Federación del 30 de diciembre de 2005. Actualizada con la reforma del Decreto por el que se adiciona la fracción VI Bis al artículo 104 de la Ley del Mercado de Valores, publicado en el Diario Oficial de la Federación el 6 de mayo de 2009)
		Títulos, preceptos y/o Epígrafes
		Título VI (De los intermediarios del mercado de valores) Art. 9,113-114. Título VIII (De los organismos autorregulatorios) Título IX (De los sistemas de negociación bursátiles y extrabursátiles) Capítulo I (Disposiciones preliminares) Capítulo II (De las bolsas de valores) Capítulo III (De los sistemas de negociación extrabursátil) Sección I (De las sociedades que administran sistemas para facilitar operaciones con valores) Título X (Del depósito, liquidación y compensación de valores) Capítulo I (De las instituciones para el depósito de valores) Capítulo II (De las contrapartes centrales de valores) Título XI (De otras entidades que participan en el desarrollo del mercado de valores)



“2015, Año del Generalísimo José María Morelos y Pavón”

		Capítulo I (De los proveedores de precios)
		REGLAS A LAS QUE HABRAN DE SUJETARSE LOS PARTICIPANTES DEL MERCADO DE CONTRATOS DE DERIVADOS LISTADOS EN BOLSA. (Publicadas en el Diario Oficial de la Federación el 31 de diciembre de 1996, modificadas mediante Resoluciones publicadas en el citado Diario el 12 de agosto y 30 de diciembre de 1998, 31 de diciembre de 2000, 14 de mayo de 2004, 19 de mayo de 2008, 24 de agosto y 25 de noviembre de 2010 y 13 de octubre de 2011, respectivamente.)
		Títulos, preceptos y/o Epígrafes
		Página Web
		www.cnbv.gob.mx
		DISPOSICIONES DE CARACTER PRUDENCIAL A LAS QUE SE SUJETARAN EN SUS OPERACIONES LOS PARTICIPANTES DEL MERCADO DE CONTRATOS DE DERIVADOS LISTADOS EN BOLSA. (Publicadas en el Diario Oficial de la Federación el 26 de mayo de 1997. Actualizadas con las modificaciones publicadas en el propio Diario el 12 de agosto de 1998, 31 de diciembre de 2000, 13 de agosto y 22 de noviembre de 2001, 4 de enero de 2005 y 23 de noviembre de 2011.)
		Títulos, preceptos y/o Epígrafes
		Página Web
		www.cnbv.gob.mx
		Disposiciones Aplicables a los Proveedores de Precios (Publicadas en el Diario Oficial de la Federación el 13 de septiembre de 1999)
		Títulos, preceptos y/o Epígrafes
		Página Web
		www.cnbv.gob.mx



“2015, Año del Generalísimo José María Morelos y Pavón”

		Reglamento Interior de la Bolsa Mexicana de Valores, S.A.B de C.V. (Versión actualizada en su página Web)
		Títulos, preceptos y/o Epígrafes
		Título Primero (Disposiciones Generales) Título Segundo (Miembros de la Bolsa) Capítulo Tercero (Formadores de Mercado) Título Quinto (Operaciones del Mercado de Capitales)
		Página Web
		www.bmv.com.mx
		Reglamento Interior de S.D. Indeval Institución para el Depósito de Valores, S.A. de C.V. (Versión actualizada en su página Web)
		Capítulo II (Depósito y Retiro de Valores) Capítulo III (Cumplimiento de las Obligaciones que deriven de la concertación de Operaciones, mediante la Liquidación)
		Página Web
		www.indeval.com.mx
		Reglamento Interior y Manual Operativo de MexDer, mercado Mexicano de Derivados, S.A de C.V. (Versión actualizada en su página Web)
		Títulos, preceptos y/o Epígrafes
		Reglamento Título Séptimo Capítulo Segundo (Medidas Precautorias y Declaración de Situaciones de Emergencia) Título Décimo (De la concertación Electrónica de Operaciones) Manual Capítulo Cuarto (Recepción de instrucciones de Operación vía telefónica)
		Página Web



“2015, Año del Generalísimo José María Morelos y Pavón”

		www.mexder.com.mx
		Reglamento Interior de Asigna Compensación y Liquidación. (Versión actualizada en su página Web)
		Títulos, preceptos y/o Epígrafes
		Capítulo Segundo (Fideicomitentes y Socios Liquidadores de la Cámara de Compensación) Apartado Primero (Disposiciones Generales) Apartado Sexto (Obligaciones de la Cámara de Compensación) Capítulo Quinto (Fondo de Aportaciones) Capítulo Sexto (Fondo de Compensación) Capítulo Octavo (Medidas Preventivas y Declaración de Situaciones de Emergencia)
		Página Web
		www.asigna.com.mx
		Reglamento Interior de la Contraparte Central de Valores de México S.A. de C.V. (Versión actualizada en su página Web)
		Títulos, preceptos y/o Epígrafes
		Capítulo I (Disposiciones Generales) Apartado Segundo (Definiciones) Apartado Tercero.(Socios y Agentes Liquidadores) Capítulo II (Agentes Liquidadores, Agentes No Liquidadores y la Contraparte Central de Valores) Apartado Cuarto (Derechos y obligaciones de los Agentes Liquidadores y Agentes No Liquidadores) Apartado Quinto (Obligaciones de la CCV) Capítulo IV (Sistema de Salvaguardas Financieras) Apartado Segundo (Conformación de los Fondos de Garantía) Apartado Tercero (Políticas de inversión de los Fondos de Garantía)



“2015, Año del Generalísimo José María Morelos y Pavón”

		Página Web
		www.contraparte-central.com.mx
Tema2:	Matemáticas Financieras	
	Subtema1:	Interés simple e interés compuesto(Conceptos y Ejercicios prácticos)
		Bibliografía
		<ul style="list-style-type: none"> • Navarro, Eliseo; Nave, Juan M: Fundamentos de Matemáticas Financieras; Barcelona, España : Antoni Bosch , 2001. Capítulos 1 y 2. • Cánovas, Roberto: Matemáticas Financieras Fundamentos y Aplicaciones, México : Trillas , c2004. Capítulos 1 y Apéndice A.
		Títulos, preceptos y/o Epígrafes
		Página Web
	Subtema2:	Tasa cero, tasa de rendimiento y tasa de descuento. (Conceptos y Ejercicios prácticos)
		Bibliografía
		<ul style="list-style-type: none"> • Navarro, Eliseo; Nave, Juan M: Fundamentos de Matemáticas Financieras; Barcelona, España : Antoni Bosch , 2001. Capítulos 1,2 y 5. • Cánovas, Roberto: Matemáticas Financieras Fundamentos y Aplicaciones, México : Trillas , c2004. Capítulos 1, 2, 5 y Apéndice A. • Fabozzi, Frank J., Bonds Markets, Analysis and Strategies, Third Edition, Prentice Hall, 1996. Capítulo 1, 2, 3 y 5.
		Títulos, preceptos y/o Epígrafes
		Página Web
	Subtema3:	Tasas efectivas, equivalentes, forward, anualizadas y continuas e Interpolación de Tasas. (Conceptos y Ejercicios prácticos)

“2015, Año del Generalísimo José María Morelos y Pavón”

		Bibliografía
		<ul style="list-style-type: none"> • Navarro, Eliseo; Nave, Juan M: Fundamentos de Matemáticas Financieras; Barcelona, España : Antoni Bosch , 2001. Capítulos 1, 2 y 5. • Cánovas, Roberto: Matemáticas Financieras Fundamentos y Aplicaciones, México : Trillas , c2004. Capítulos 1, 2, 5 y Apéndice A. • Nelson, C. R. and A. F. Siegel. “Parsimonious Modeling and Yield Curves,” Journal of Business 60 (October 1987), Páginas. 473-489.
		Títulos, preceptos y/o Epígrafes
		Página Web
Tema3:	Mercado de Deuda	
	Subtema1:	Conceptos
		Bibliografía
		Fabozzi, Frank J., Bonds Markets, Analysis and Strategies, Third Edition, Prentice Hall, 1996. Capítulos 1,2,3,5.
		Títulos, preceptos y/o Epígrafes
		Precepto 1. Valor nominal. Precepto 2. Cupones. Precepto 3. Intereses devengados, cupón corriente. Precepto 4. Rendimiento al vencimiento(YTM) Precepto 5. Bajo, a y sobre Par. Precepto 6. Riesgo de Crédito. Precepto 7. Mercado Primario y Secundario. Precepto 8. Opcionalidad, Estructurados, Bursatilizaciones. Precepto 9. Duración y Convexidad.
		Página Web
	Subtema 2:	Clasificación de Bonos

“2015, Año del Generalísimo José María Morelos y Pavón”

		Bibliografía
		Fabozzi, Frank J., Bonds Markets, Analysis and Strategies, Third Edition, Prentice Hall, 1996. Capítulos 6 al 16 Banco de México. Subastas y colocación de valores. (Todo el contenido de la liga indicada)
		Títulos, preceptos y/o Epígrafes
		Precepto 1. Cupón cero. Precepto 2. Cuponados.
		Página Web
		http://www.banxico.org.mx/sistema-financiero/material-educativo/intermedio/subastas-y-colocacion-de-valores/subastas-colocacion-valores.html
Tema4:	Mercado de Derivados	
	Subtema1:	Mercados Listados y Mercados OTC
		Bibliografía
		<ul style="list-style-type: none"> Hull, John C., Options, Futures, and Other Derivatives, Third Edition, Prentice Hall, 1997, Capítulos 1,3 International Swaps and Derivatives Association (ISDA)
		Títulos, preceptos y/o Epígrafes
		Precepto 1. Principales Características. Precepto 2. Diferencias. Precepto 3. International Swaps and Derivatives Association (ISDA) Precepto 4. Instrumentos listados en MexDer.
		Página Web
		www.isda.org
	Subtema 2:	Futuros / Forwards
		Bibliografía
		<ul style="list-style-type: none"> Hull, John C., Options, Futures, and Other Derivatives, Third Edition, Prentice Hall, 1997. Capítulos 1,2,3,4,12,13,14
		Títulos, preceptos y/o Epígrafes



“2015, Año del Generalísimo José María Morelos y Pavón”

		<p>Precepto 1. Características generales.</p> <p>Precepto 2. Posición larga y corta.</p> <p>Precepto 3. Valuación y marca a mercado.</p> <p>Precepto 4. Futuros.</p> <p>Precepto 5. Forwards</p>
		Página Web
	Subtema 3:	Swaps
		Bibliografía
		<ul style="list-style-type: none"> Hull, John C., Options, Futures, and Other Derivatives, Third Edition, Prentice Hall, 1997. Capítulos 1,5,13,14,17 International Swaps and Derivatives Association (ISDA)
		Títulos, preceptos y/o Epígrafes
		<p>Precepto 1. Definiciones.</p> <p>Precepto 2. Clasificación.</p> <p>Precepto 3. Valuación y Marca a Mercado.</p> <p>Precepto 4. Swaps de tipo de cambio.</p> <p>Precepto 5. Interest Rate Swaps (IRS)</p>
		Página Web
		www.isda.org
	Subtema 4:	Opciones.
		Bibliografía
		<ul style="list-style-type: none"> Hull, John C., Options, Futures, and Other Derivatives, Third Edition, Prentice Hall, 1997. Capítulos 1,6,7,8,9,11,12,13,14,16,18,19
		Títulos, preceptos y/o Epígrafes
		<p>Precepto 1. Definiciones.</p> <p>Precepto 2. Posiciones básicas en contratos de opción.</p> <p>Precepto 3. Factores en la determinación de la prima.</p> <p>Precepto 4. Valor intrínseco y valor temporal o extrínseco.</p> <p>Precepto 5. Opciones “Dentro/En/Fuera” del Dinero.</p> <p>Precepto 6. Paridad Put–Call.</p>



“2015, Año del Generalísimo José María Morelos y Pavón”

		Precepto 7. Opciones Americanas y Europeas. Precepto 8. Modelos de valuación de opciones: Binomial y Black&Sholes.
		Página Web

