



Universitat de Lleida

GUIA DOCENT
**MERCATS FINANCERS I
GESTIÓ DE CARTERES**

Coordinació: Josep Maria Riu

Any acadèmic 2013-14

Informació general de l'assignatura

Denominació	MERCATS FINANCERS I GESTIÓ DE CARTERES
Codi	101338
Semestre d'impartició	1r Q Avaluació Continuada
Caràcter	Optativa
Nombre de crèdits ECTS	6
Crèdits teòrics	0
Crèdits pràctics	0
Coordinació	Josep Maria Riu
Departament/s	AEGERN
Informació important sobre tractament de dades	Consulteu aquest enllaç per a més informació.
Idioma/es d'impartició	70% Català 20% Castellà 10% Anglès
Horari de tutoria/lloc	Josep M. Riu: Dimecres de 18:00 a 19:30 (Cal cita prèvia) Despatx: 1.27 Xavi Sabi: Dimecres 11:00 a 13:00 i 15:00 a 17:00 Despatx: 1.17

Josep M^a Riu
Xavier Sabi

Objectius acadèmics de l'assignatura

L'objectiu és el de mostrar a l'alumne el funcionament dels mercats financers tant a nivell nacional com internacional estudiant els actius financers que s'hi negocien, els seus riscos i la mateixa negociació

Concretament:

- Actius negociats en el mercat monetari.
- Actius negociats en el mercat de capitals, tant de renda fixa como de renda variable.
- Conèixer els productes financers d'inversió col·lectiva (fons d'inversió)
- Conèixer els conceptes fonamentals dels mercats de futurs, de derivats i de divises

L'enfocament de l'assignatura és bàsicament pràctic, amb un seguiment constant dels mercats financers i de la informació que generen.

Aprendrem a utilitzar les eines emprades pels professionals dels mercats financers i a invertir i dissenyar diferents carteres en funció dels diferents perfils de risc

Competències

Generals:

- Capacitat d'aprenentatge i treball autònom
- Habilitat per analitzar i buscar informació provinent de fonts diverses aplicables a l'àmbit d'estudi.
- Capacitat d'anàlisi i síntesi.
- Capacitat per la presa de decisions.
- Capacitat d'organització i planificació.
- Capacitat d'adaptació a noves situacions o situacions canviants.
- Coneixements d'informàtica relatius a l'àmbit d'estudi.
- Capacitat per gestionar la informació.
- Capacitat per aplicar els coneixements a la pràctica.

Específiques:

- Capacitat per comprendre les operacions financeres i els fenòmens que inciden en les decisions financeres
- Entendre els fonaments dels mercats financers per la presa de decisions en l'àmbit de la gestió de patrimonis i l'assessorament financer
- Lectura i interpretació de textos financers.
- Interpretació i tractament de dades financeres procedents de la Borsa de Valors fundamentalment
- Aplicar la teoria de carteres en la gestió d'un patrimoni

Continguts fonamentals de l'assignatura

1.- INTRODUCCIÓ ALS SISTEMA FINANCER I ALS MERCATS FINANCERS

- COMPONENTS DELS MERCATS FINANCERS
- ESTRUCTURA I FUNCIONAMENTS DELS MERCATS FINANCERS

- POLÍTICA ECONÒMICA I CICLES ECONÒMICS

2.- EL MERCAT DE RENDA VARIABLE

- EL MERCAT BURSÀTIL
- CRITERIS DE SELECCIÓ D'ACCIONS: ANÀLISI FONAMENTAL I ANÀLISI TÈCNIC

3.- EL MERCAT MONETARI I DE RENDA FIXA

- ESTRUCTURA TEMPORAL DELS TIPUS D'INTERÉS
- EL MERCAT INTERBANCARI
- EL MERCAT DE DEUTE PÚBLIC
- EL MERCAT DE DEUTE PRIVAT

4.- EL MERCAT DE DIVISES

- EL RISC DE CANVI
- LA FORMACIÓ DE PREUS
- OPERACIONS AMB DIVISES

5.- EL MERCAT DE DERIVATS

- ELS FUTURS FINANCERS
- LES OPCIONS FINANCERES

6.- ELS FONS D'INVERSIÓ

- CARACTERÍSTIQUES I TIPOLOGIA DE F.I.
- ANÀLISI I SELECCIÓ DE F.I.

7.- INTRODUCCIÓ A LA GESTIÓ DE CARTERES

- LA TEORIA DE CARTERES
- ESTILS DE GESTIÓ

Sistema d'avaluació

- Primera prova test 29%
- Segona prova test 29%
- Exerci pràctic 29%
- Comentaris Articles i estudis reals. 13%

Bibliografia i recursos d'informació

- JOSE LUIS MARTIN-ANTONIO TRUJILLO, Mercados de activos financieros , DELTA PUBLICACIONES 2011
- ROBERT D. EDWARDS & JOHN MAGEE, Análisis técnico de la tendencia de los valores, GESMOVASA, 1995
- BENJAMIN GRAHAM, El inversor inteligente, DEUSTO S.A. EDICIONES, 2007
- ANDRE KOSTOLANY, El fabulosos mundo del dinero y la bolsa, Ed GARGOLA SL, 2011
- BURTON G. MALKIEL, Un paseo aleatorio por Wall Street, ALIANZA EDITORIAL, 2013
- JOSE ANTONIO FERNANDEZ HODAR, Manual del buen bolsista, PEARSON EDUCACION, 2006
- ROBERT G. HAGSTROM, Warren Buffet, EDICIONES GESTION 2000, 2006
- PETER LYNCH, Un paso por delante de la bolsa, ED. NORBERT BARTL
- MICHAEL LEWIS , El poquer del mentiroso, ARIEL, 1990