



Universitat de Lleida

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

Coordinació: RIU VILA, JOSEP MARIA

Any acadèmic 2017-18

Informació general de l'assignatura

Denominació	MERCATS FINANCERS I GESTIÓ DE CARTERES			
Codi	101338			
Semestre d'impartició	1R Q(SEMESTRE) AVALUACIÓ CONTINUADA			
Caràcter	Grau/Màster	Curs	Caràcter	Modalitat
	Grau en Administració i Direcció d'Empreses	4	OPTATIVA	Presencial
Nombre de crèdits ECTS	6			
Grups	1GG			
Crèdits teòrics	0			
Crèdits pràctics	0			
Coordinació	RIU VILA, JOSEP MARIA			
Departament/s	ADMINISTRACIO D'EMPRESES			
Informació important sobre tractament de dades	Consulteu aquest enllaç per a més informació.			
Idioma/es d'impartició	70% Catala 20% Castella 10% Angles			
Horari de tutoria/lloc	Josep M. Riu: Dilluns de 13:00 a 14:30 (Cal cita prèvia) Despatx: 1.27 Xavi Sabi: Dimecres 11:00 a 13:00 i 15:00 a 17:00 Despatx: 1.17			

Professor/a (s/es)	Adreça electrònica professor/a (s/es)	Crèdits impartits pel professorat	Horari de tutoria/lloc
RIU VILA, JOSEP MARIA	jriu@aegern.udl.cat	3	
SABI MARCANO, FRANCISCO JAVIER	xavisabi@aegern.udl.cat	3	

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

Pla de desenvolupament de l'assignatura

12 SETEMBRE presentació. XAVIER SABI

18-19-25 SETEMBRE TEMA 1 XAVIER SABI

26 SETEMBRE 2-3-9-10-17 OCT TEMA 2 XAVIER SABI

16-23-24 OCTUBRE TEMA 2 JOSEP MARIA RIU

30-31 OCTUBRE TEMA 3 XAVIER SABI

10 NOVENBRE EXÀMEN TEST TEMES1-3

13-14 NOVENBRE TEMA 3 XAVIER SABI

20 NOVENBRE TEMA 3 JOSEP MARIA RIU

21 NOVENBRE EXAMEN PRÀCTIC TEMA 2 i 3

27 NOVENBRE TEMA 4 XAVIER SABI

28 NOVENBRE TEMA 4 JOSEP MARIA RIU

4-5-11 DESEMBRE TEMA 5 JOSEP MARIA RIU

12-18 DESEMBRE TEMA 6 JOSEP MARIA RIU

19 DESEMBRE EXÀMEN PRÀCTIC TEMES 4-6

8-9 GENER TEMA 7 JOSEP MARIA RIU

18 GENER: EXÀMEN FINAL

Sistema d'avaluació

- Primera prova test 10 novembre - 29% Temes 1 i 2 i 3
- Prova casos pràctics 21 novembre - 21% Temes 1, 2 i 3
- Prova casos pràctics 19 desembre 21% - temes 4, 5 i 6
- Examen final tipus test 18 gener 29% - .Tot el temari. .

Aclariments:

- Les proves test son obligatòries.
- Els exercicis pràctics son voluntaris
- Per poder superar l'assignatura és necessari treure una nota mínima de 4 en l'exàmen final.

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
- MATTEO MOTTERLINI, Economia Emocional, ED. PAIDOS IBERICA, 2008
- PEDRO BERMEJO, El cerebro del inversor, ED PIRAMIDE 2015
- DAVID DREMAN, Estrategias de Inversión a contracorriente, ED. DEUSTO 2013
- PADRO BERMENJO Y RICARDO IZQUIERDO, Tu dinero y tu cerebro, ED. CONECTA 2013