



Universitat de Lleida

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

Coordinació: SABI MARCANO, FRANCISCO JAVIER

Any acadèmic 2021-22

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 assignatura (ECTS)	6			
Tipus d'activitat, crèdits i grups	Tipus d'activitat	PRAULA	TEORIA	
	Nombre de crèdits	2.7	3.3	
	Nombre de grups	1	1	
Coordinació	SABI MARCANO, FRANCISCO JAVIER			
Departament/s	ADMINISTRACIÓ 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			

Professor/a (s/es)	Adreça electrònica professor/a (s/es)	Crèdits impartits pel professorat	Horari de tutoria/lloc
RIU VILA, JOSEP MARIA	josepmaria.riu@udl.cat	2,7	
SABI MARCANO, FRANCISCO JAVIER	xavi.sabi@udl.cat	3,3	

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
- Capacitat d'organitzar i planificar.
- 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

Eixos metodològics de l'assignatura

Desenvolupament continguts teòrics de l'assignatura i pràctiques sobre els continguts treballats amb una aula d'ordinadors. Resolució de casos reals, comentari situació actual mercats, debats a l'aula.

Pla de desenvolupament de l'assignatura

13 SETEMBRE Presentació Xavier Sabi
13-15-20 SETEMBRE TEMA 1 Xavier Sabi
20-22-27 SETEMBRE 4-6 OCT TEMA 2 Xavier Sabi
11-13 OCTUBRE TEMA 2 Josep Maria Riu
18-20-25-27 OCTUBRE TEMA 3 Xavier Sabi
3 NOVENBRE: Conferencia
12 NOVENBRE: Examen temes 1-3
15 NOVENBRE Tema 4: Xavier Sabi
17 NOVENBRE: Conferencia
22-24 NOVENBRE: Tema 5 Jospe Maria Riu
29 NOVENBRE - 1 DESEMBRE TEMA 6: Josep Mariua Riu
13-15 DESEMBRE Tema 7 Josep Maria Riu
20 DESEMBRE: CONFERENCIA
22 DESEMBRE Examen pràctic
13 GENER EXÀMEN FINAL SINTESIS

Sistema d'avaluació

- Primera prova test 12 novembre - 20% Temes 1 i 2 i 3
- Prova Pràctica 22 desembre 25% - Temes 4, 5 i 6
- Segona prova test (síntesis) 13 Gener 29% Temes 1-6
- Treball Gestió de Carteres (26%)

Aclariments:

- Les proves test son obligatòries.
- La prova pràctica i el treball són optatius.
- Per poder superar l'assignatura és necessari treure una nota mínima de 4 en l'exàmen de síntesis

Qui vulgui acudir a Avaluació alternativa tindrà que fer un examen global de tota l'assignatura que tindrà una part teòrica i una pràctica i que es farà el dia 13 de Gener

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