



Universitat de Lleida

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

Coordinació: SABI MARCANO, FRANCISCO JAVIER

Any acadèmic 2023-24

## Informació general de l'assignatura

<b>Denominació</b>	MERCATS FINANCERS I GESTIÓ DE CARTERES			
<b>Codi</b>	101338			
<b>Semestre d'impartició</b>	1R Q(SEMESTRE) AVALUACIÓ CONTINUADA			
<b>Caràcter</b>	<b>Grau/Màster</b>	<b>Curs</b>	<b>Caràcter</b>	<b>Modalitat</b>
	Grau en Administració i Direcció d'Empreses	4	OPTATIVA	Presencial
<b>Nombre de crèdits assignatura (ECTS)</b>	6			
<b>Tipus d'activitat, crèdits i grups</b>	<b>Tipus d'activitat</b>	PRAULA	TEORIA	
	<b>Nombre de crèdits</b>	2.7	3.3	
	<b>Nombre de grups</b>	1	1	
<b>Coordinació</b>	SABI MARCANO, FRANCISCO JAVIER			
<b>Departament/s</b>	ECONOMIA I EMPRESA			
<b>Informació important sobre tractament de dades</b>	Consulteu <a href="#">aquest enllaç</a> per a més informació.			
<b>Idioma/es d'impartició</b>	70% Català 20% Castellà 10% Anglès			

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

Setmana 1 Presentació

Setmana 1-2 TEMA 1

Setmana 3-6 TEMA 2

Setmana 7-8 TEMA 3

Setmana 9 Examen

Setmana 10-11 TEMA 4

Setmana 11-12 TEMA 5

Setmana 13 TEMA 6

Setmana 14-15 TEMA 7

Setmana 16 Examen

## Sistema d'avaluació

- Primera prova test 22% Temes 1 i 2 i 3
- Prova Pràctica 25% - Temes 2-6
- Segona prova test (síntesis) 29% Temes 1-6
- Sessions pràctiques i treball (24%)

Aclariments:

- Les proves test son obligatòries. En el darrer test s'ha de treure un 4 per fer mitja. Si no s'arriba al 4 i la mitja dona aprovat es podrà recuperar la nota.
- La prova pràctica i el treball són optatius.

### **Avaluació única o alternativa**

En cas que un/a estudiant acrediti documentalment la seva impossibilitat d'assistir a les activitats programades dins l'avaluació continuada (per treball remunerat, segona o ulterior matrícula de l'assignatura, conciliació de la vida laboral i familiar i estades de mobilitat) podrà optar a una prova d'avaluació única. Aquesta prova està sotmesa a la normativa d'avaluació, de manera que, totes les proves que superin el percentatge del 30%, són objecte de recuperació. Igualment, els alumnes tindran dret a la revisió de la prova d'avaluació única. La data d'aquesta prova única serà la mateixa que la de lla prova de síntesis test 2 (reviseu la web del grau en ADE per conèixer la data concreta); i inclourà tot el temari.

A la pàgina web de la Facultat hi ha el document que han d'omplir els alumnes i lliurar al professor responsable de l'assignatura: <http://www.fdet.udl.cat/export/sites/Fdet/ca/.galleries/Documents/Secretaria-documents/Sollicitud-davaluacio-alternativa.pdf>

### **Plagi**

L'article 9 de la Normativa d'Avaluació estableix que l'estudiant no pot utilitzar durant la realització de les activitats

d'avaluació mitjans no permesos o mecanismes fraudulents. L'estudiant que utilitzi qualsevol mitjà fraudulent relacionat amb la prova i/o porti aparells electrònics no permesos, quedarà subjecte a les conseqüències previstes en aquesta normativa o en qualsevol normativa de règim intern de la UdL.

L'article 43 de la Normativa de convivència de la UdL descriu les sancions aplicables, que inclouen, entre d'altres i depenent de la gravetat de la falta, la pèrdua del dret a ser avaluat de l'assignatura, la pèrdua de la matrícula d'un semestre o un curs o l'expulsió fins a tres anys.

El termini per presentar la documentació finalitza el 20 d'octubre de 2023

## 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