



Universitat de Lleida

GUÍA DOCENTE  
**MERCADOS FINANCIEROS Y  
GESTIÓN DE CARTERAS**

Coordinación: SABI MARCANO, FRANCISCO JAVIER

Año académico 2022-23

## Información general de la asignatura

<b>Denominación</b>	MERCADOS FINANCIEROS Y GESTIÓN DE CARTERAS			
<b>Código</b>	101338			
<b>Semestre de impartición</b>	1R Q(SEMESTRE) EVALUACIÓN CONTINUADA			
<b>Carácter</b>	Grado/Máster	Curso	Carácter	Modalidad
	Grado en Administración y Dirección de Empresas	4	OPTATIVA	Presencial
<b>Número de créditos de la asignatura (ECTS)</b>	6			
<b>Tipo de actividad, créditos y grupos</b>	<b>Tipo de actividad</b>	PRAULA	TEORIA	
	<b>Número de créditos</b>	2.7	3.3	
	<b>Número de grupos</b>	1	1	
<b>Coordinación</b>	SABI MARCANO, FRANCISCO JAVIER			
<b>Departamento/s</b>	ADMINISTRACIÓN DE EMPRESAS			
<b>Información importante sobre tratamiento de datos</b>	Consulte <a href="#">este enlace</a> para obtener más información.			

Profesor/a (es/as)	Dirección electrónica\nprofesor/a (es/as)	Créditos impartidos por el profesorado	Horario de tutoría/lugar
RIU VILA, JOSEP MARIA	josepmaria.riu@udl.cat	2,7	
SABI MARCANO, FRANCISCO JAVIER	xavi.sabi@udl.cat	3,3	

## Objetivos académicos de la asignatura

El objetivo es el de mostrar al alumno el funcionamiento de los mercados financieros tanto a nivel nacional como internacional estudiando los activos financieros que se negocian, sus riesgos y la misma negociación concretamente: Activos negociados en el mercado monetario. Activos negociados en el mercado de capitales, tanto de renta fija como de renta variable. Conocer los productos financieros de inversión colectiva (fondos de inversión) Conocer los conceptos fundamentales de los mercados de futuros, de derivados y de divisas El enfoque de la asignatura es básicamente práctico, con un seguimiento constante de los mercados financieros y de la información que generan. Aprenderemos a utilizar las herramientas utilizadas por los profesionales de los mercados financieros y en invertir y diseñar diferentes carteras en función de los diferentes perfiles de riesgo

## Competencias

generales:

- Capacidad de aprendizaje y trabajo autónomo
- Capacidad de organizar y planificar
- Capacidad de análisis y síntesis.
- Capacidad para la toma de decisiones.
- Capacidad de organización y planificación.
- Capacidad de adaptación a nuevas situaciones o situaciones cambiantes.
- Conocimientos de informática relativos al ámbito de estudio.
- Capacidad para gestionar la información.
- Capacidad para aplicar los conocimientos a la práctica.

específicas:

- Capacidad para comprender las operaciones financieras y los fenómenos que inciden en las decisiones financieras
- Entender los fundamentos de los mercados financieros para la toma de decisiones en el ámbito de la gestión de

patrimonios y el asesoramiento financiero

- Lectura e interpretación de textos financieros.
- Interpretación y tratamiento de datos financieros procedentes de la Bolsa de Valores fundamentalmente
- Aplicar la teoría de carteras en la gestión de un patrimonio

## Contenidos fundamentales de la asignatura

### 1.- INTRODUCCIÓN A SISTEMA FINANCIERO Y LOS MERCADOS FINANCIEROS

- COMPONENTES DE LOS MERCADOS FINANCIEROS
- ESTRUCTURA y funcionamientos LOS MERCADOS FINANCIEROS
- POLÍTICA ECONÓMICA Y CICLOS ECONÓMICOS

### 2 ..- EL MERCADO DE RENTA VARIABLE

DESCRIPCIÓN MERCADO BURSÁTIL: CONCEPTOS FUNDAMENTALES

CRITERIOS DE SELECCIÓN DE ACCIONES: ANÁLISIS FUNDAMENTAL Y ANÁLISIS TÉCNICO

### 3.- EL MERCADO MONETARIO Y DE RENTA FIJA

ESTRUCTURA TEMPORAL DE LOS TIPOS DE INTERÉS

EL MERCADO INTERBANCARIO

EL MERCADO DE DEUDA PÚBLICA

EL MERCADO DE DEUDA PRIVADA

### 4.- EL MERCADO DE DIVISAS

EL RIESGO DE CAMBIO

LA FORMACIÓN DE PRECIOS

OPERACIONES CON DIVISAS

### 5.- EL MERCADO DE DERIVADOS

LOS FUTUROS FINANCIEROS

LAS OPCIONES FINANCIERAS

### 6.- LOS FONDOS DE INVERSIÓN

CARACTERÍSTICAS Y TIPOLOGÍA DE F.I.

ANÁLISIS Y SELECCIÓN DE F.I.

## 7.- INTRODUCCIÓN A LA GESTIÓN DE CARTERAS

LA TEORÍA DE CARTERAS

ESTILOS DE GESTIÓN

## Ejes metodológicos de la asignatura

Desarrollo contenidos teóricos de la asignatura y prácticas sobre los contenidos trabajados con un aula de ordenadores. Resolución de casos reales, comentario situación actual mercados, debates en el aula.

## Plan de desarrollo de la asignatura

17 SEPTIEMBRE Presentación

17-18-24 SEPTIEMBRE TEMA 1 Xavier Sabi

24-25 SEPTIEMBRE 1-2-8-9 OCT TEMA 2 Xavier Sabi

15-16 OCTUBRE TEMA 3 Xavier Sabi

22-23-29-30 OCTUBRE TEMA 2 y 3 Josep Maria Rius

8 NOVIEMBRE: 18:00 EXAMEN TEST TEMES1-3

12-13 NOVIEMBRE TEMA 3 Xavier Sabi

19 NOVIEMBRE EXAMEN PRÁCTICO TEMA 2 y 3

20-26 NOVIEMBRE TEMA 4 Josep Maria Riu

27 NOVIEMBRE 3-4 DICIEMBRE TEMA 5 Jospe María Riu

10-11 DICIEMBRE TEMA 6 Josep Mariua Riu

17-18 DICIEMBRE TEMA 7 José María Riu

10 ENERO: EXAMEN FINAL y PRÁCTICO temas 4-6

## Sistema de evaluación

Primera prueba test 08 de noviembre - 29% de Temas 1 y 2 y 3

Prueba casos prácticos 19 de noviembre - 21% de Temas 1, 2 y 3

Prueba casos prácticos 10 de enero 21% - temas 4, 5 y 6

Examen final tipo test 10 de enero 29% - Todo el temario.

aclaraciones: - Las pruebas test son obligatorias. - Los ejercicios prácticos son voluntarios - Para poder superar la asignatura es necesario sacar una nota mínima de 4 en el examen final.

## Bibliografía y recursos de información

- 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, Economía 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