

Assignatura: **MERCATS I INSTRUMENTS FINANCERS**
Codi: **16051208** Crèdits: **6**
Tipus: **Optativa** Cicle: **1r** Curs: **3r** Quadrimestre: **2n**
Departament: **Gestió d'Empreses**
Àrea: **Economia Financera i Comptabilitat**
Professorat: **Susanna Sardà**

Objetius generals:

Aquesta assignatura proporciona a l'alumne els fonaments del sistema financer així com dels mercats financers i els actius que s'hi negocien. Finalment s'estudia la gestió de carteres clàssica i les estratègies bàsiques per a la gestió de carteres de renda fixa.

Criteris d'avaluació:

Caldrà superar un examen teòric/pràctic.

Assignatures que es recomana haver cursat prèviament/simultàniament:

Matemàtiques de les Operacions Financeres
Estadística
Direcció Financera I
Direcció Financera II

Assignatures en les quals s'apliquen els continguts d'aquesta:

Bibliografia bàsica:

Borrego, A. Y García, P. *Productos Financieros*. Madrid: Prentice Hall, 2002.
Instituto Español de Analistas Financieros. *Curso de bolsa y mercados financieros*. 3a ed. Barcelona: Ariel, 2001.
Mascareñas, J. *Gestión de activos financieros de renta fija*. Madrid: Pirámide, 2002.

Bibliografia complementària:

Analistas Financieros Internacionales. *El mercado español de deuda pública en euros*. Madrid: Escuela de Finanzas Aplicadas, 1999.
Analistas Financieros Internacionales. *Guía del sistema financiero español*.. Madrid: Escuela de Finanzas Aplicadas, 2000.
Bierwag, G.O. *Análisis de la duración*. Madrid: Alianza Editorial, 1991.
Meneu, V.; Navarro, E. ; Barreira, M. T. *Análisis y Gestión del riesgo de interés*. Barcelona: Ariel, 1992.
Parejo, J.A., Cuervo, A., Calvo, A. Y Rodríguez, L. *Manual del Sistema financiero Español*, 14a ed. Barcelona: Ariel, 2001.

Programa:

- 1. La inversió financera i el problema de les carteres**
 - 1.1. Les inversions financeres
 - 1.2. Estructura i operatòria dels mercats financers
 - 1.3. Introducció a la formació i selecció de carteres de valors
- 2. Els Mercats Monetaris i els actius que s'hi negocien**
 - 2.1. Introducció
 - 2.2. El mercat interbancari
 - 2.3. Les lletres del tresor
 - 2.4. Els pagarés d'empresa
- 3. Els Mercats de Capitals i els actius que s'hi negocien**
 - 3.1. Els mercats organitzats de renda fixa
 - 3.2. Bons i obligacions del tresor
 - 3.3. Els actius de renda fixa privada
 - 3.4. Els mercats de renda variable
 - 3.5. Els actius de renda variable
- 4. Gestió de carteres de renda fixa**
 - 4.1. Valoració d'actius de renda fixa
 - 4.2. L'ETTI
 - 4.3. La duració i la convexitat dels bons
 - 4.4. Estratègies de gestió passives i actives
- 5. Gestió de carteres de renda variable**
 - 5.1. Anàlisi fonamental
 - 5.2. Anàlisi tècnic
 - 5.3. La teoria de carteres