

Plan 248 Lic.CC.Actuariales y Financieras

Asignatura 43600 MATEMATICA FINANCIERA

Grupo 1

### Presentación

Elección y valoración financiera. Teoría de la inversión, valoración de activos financieros y de la cartera. Matemática de las operaciones financieras. Teoría del riesgo e inmunización financiera. Teoría de los mercados financieros.

### Programa Básico

### Objetivos

Además de proporcionar al alumno los conocimientos básicos sobre la fundamentación conceptual de la matemática de las operaciones financieras, esta asignatura tiene por objetivo familiarizar al estudiante con los principales métodos de valoración de activos financieros de renta fija y de renta variable. Se pretende, en consecuencia, transmitir las pautas teóricas de valoración financiera a fin de que el alumno sea capaz de diseñar estrategias de gestión de carteras y de cobertura de riesgos susceptibles de ser aplicadas en los mercados españoles de capitales.

### Programa de Teoría

Las explicaciones teóricas y los ejercicios resueltos en clase se complementarán con clases prácticas en la sala de ordenadores de la Facultad. Del programa de prácticas destaca la elaboración de una cartera de renta variable que, basándose en información real de la Bolsa española durante el primer cuatrimestre de 2004, se realizará los días 10, 12, 17, 19, 21 y 24 de mayo de 2004

### Programa Práctico

### Evaluación

FERRUZ AGUDO, L.; PORTILLO TARRAGONA, M.P. y SARTO MARZAL, J.L. (2001): "Dirección financiera del riesgo de interés". Pirámide. Madrid.

GÓMEZ BEZARES, F. (1991): "Dirección financiera (Teoría y aplicaciones)". Desclée de Brouwer. Bilbao.

MENEU, V.; NAVARRO, E. y BARREIRA, M<sup>a</sup> T. (1992): "Análisis y gestión del riesgo de interés". Ariel. Barcelona.

### Bibliografía

True