

Plan 248 Lic.CC.Actuariales y Financieras

Asignatura 43607 DIRECCION DE ENTIDADES FINANCIERAS

Grupo 1

Presentación

Programa Básico

La teoría financiera. Decisiones financieras y mercados de capitales. Modelos de valoración de activos financieros en equilibrio. Futuros y contratos a plazo. Opciones financieras: conceptos. Opciones financieras: valoración. Opciones financieras: estrategias. Construcción y gestión de una cartera de activos financieros. Medición y control de resultados de una cartera de activos financieros

Objetivos

Programa de Teoría

Tema 1. La teoría financiera Tema 2. Decisiones financieras y mercados de capitales Tema 3. Modelos de valoración de activos financieros en equilibrio Tema 4. Futuros y contratos a plazo Tema 5. Opciones financieras: conceptos Tema 6. Opciones financieras: valoración Tema 7. Opciones financieras: estrategias Tema 8. Construcción y gestión de una cartera de activos financieros Tema 9. Medición y control de resultados de una cartera de activos financieros

Programa Práctico

Evaluación

Bibliografía

* FERNÁNDEZ, P. (1996): "Opciones, futuros e instrumentos derivados". Deusto. * MARTÍNEZ ABASCAL, E. (1999): "Invertir en Bolsa", McGraw-Hill, Madrid. BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA: * AYELA, R.M. (1997): "Futuros financieros, características, valoración y evidencia empírica", Publicaciones de la Universidad de Alicante, Alicante. * BIERWAG, G.O. (1987): "Duration analysis: managing interest rate risk", Ballinger Publishing Co., Cambridge, Massachusetts. * CASANOVAS RAMÓN, M. (1997): "Opciones financieras", Pirámide. * CÓRDOBA BUENO, M. (2000): "La práctica de los mercados financieros", Dykinson. * COX, J.C. y RUBINSTEIN, M. (1985): "Options markets", Prentice Hall, Englewood Cliffs, New Jersey. * DATTATREYA, R.E.; VENKATESH, R.E.S. y VENKATESH, V.E. (1995): "Swaps sobre tipos de interés y sobre divisas, mercados, productos y aplicaciones", Gesmovasa, Madrid. * DÍAZ RUIZ, E., y LARRAGA, P. (1995): "Los mercados españoles: opciones y futuros financieros", Centro de documentación bancaria y bursátil. * ELTON, E.J. y GRUBER, M.J. (1995): "Modern portfolio theory and investment analysis," quinta edición, Wiley, New York. * FABOZZI, F.J. (1993): "Bond markets analysis and strategies", segunda edición, Prentice Hall, New Jersey. * FABOZZI, F.J. (1989): "Portfolio and investment management", Probus, Chicago. * FIGLEWSKI, S., JOHN, K. y MERRICK, J. (1986): "Hedging with financial futures for institutional investors, from theory to practice", First, Ballinger Pub, Co., Cambridge, Massachusetts. * FIGLEWSKI, S., SILBER, W.L. y SUBRAHMANYAM, M.G. (1990): "Financial options: from theory to practice", Irwin, Homewood, Illinois. * FRANCIS, J.C. (1988): "Management of investments", McGraw-Hill, USA. * GASTINEAU, G.L. (1988): "The options manual", tercera edición, McGraw-Hill, Madrid. * GÓMEZ ANSON, S., GONZÁLEZ MÉNDEZ, V.M., y MENÉNDEZ REQUEJO,

S. (2000): "Problemas de dirección financiera", Cívitas. * HAUGEN, R.A. (1997): "Modern investment theory", cuarta edición, Prentice-Hall, Englewood Cliffs, N.J. : * HODGES, S. (1990): "Options, recent advances in theory and practice", Manchester University Press, Manchester, UK. * HULL, J.C. (1995): "Introducción a los mercados de opciones y futuros", Prentice Hall, Englewood Cliffs, New Jersey. * HULL, J.C. (1999): "Options futures and other derivative securities", cuarta edición, Prentice Hall. * KOLB, R.W. (1998): "Practical readings in financial derivatives", Blackwell, Oxford, UK. * KOLB, R.W. (2000): "Futures, options and swaps", tercera edición, Blackwell, Oxford, UK. * KOLB, R.W. (1997): "The options primer", Blackwell, Oxford, UK * LAMOTHE FERNÁNDEZ, Prosper (1993) "Opciones financieras: Un enfoque fundamental", McGraw-Hill, Madrid. * LAMOTHE FERNÁNDEZ, P. y PRIETO PÉREZ, F. (1991): "Los activos de renta fija. Valoración y principios de gestión", Bolsa de Madrid. * LAMOTHE, P. y SOLER, J.A. (1996) "Swaps y otros derivados OTC en tipos de interés", McGraw-Hill, Madrid. * LOFHOUSE, S. (1994): "Readings in investments", Wiley, England. * LUSKIN, D.L. (1987): "Index options and futures", Wiley, England. * MALLIARIS, A.G. (1997): "Futures markets", vols. I, II, y III, Elgar Reference Collection, UK. * MARTÍN, M., MARTÍN, J.L., OLIVER, M.D., y TORRE, A. (1995): "La operativa en los mercados financieros: casos prácticos", Ariel Economía. * MARTÍNEZ ABASCAL, E. (1993): "Futuros y opciones en la gestión de carteras", McGraw-Hill, Madrid. * RADCLIFFE, R.C. (1997): "Investment: concepts, analysis, strategy, quinta edición, Addison-Wesley * RODRÍGUEZ SÁIZ, L.; PAREJO GAMIR, J.A.; CUERVO GARCÍA, A.; CALVO BERNARDINO, A. (2000): "Manual del sistema financiero español", 13ª edición, Ariel. * SHARPE, W.F.; ALEXANDER, G.J. y BAILEY, J.V. (1998): "Investments", sexta edición, Prentice Hall International, New Jersey. * SMITHSON, C.W. (1998): "Managing financial risk", third edition, Irwin Library, New York. * STRONG, R.A. (2000): "Portfolio construction, management and protection", segunda edición, Sout Western, Thomson Learning. * VALLELADO, E. (1997) "Nuevos Mercados Financieros: las opciones sobre el Ibex", Servicio de Publicaciones de la Universidad de Valladolid, Valladolid.