

Plan 300 Lic.Admon.y Dirección Empresas

Asignatura 43649 INVERSIONES FINANCIERAS

Grupo 1

### Presentación

Las inversiones financieras: riesgo y rentabilidad. Modelos de selección de carteras y de valoración de activos financieros. Análisis bursátil: fundamental y técnico. La eficiencia de los mercados financieros.

### Programa Básico

### Objetivos

### Programa de Teoría

Programa de Teoría:

1. El marco institucional de las decisiones financieras.
  - 1.1. La inversión financiera.
  - 1.2. Los mercados financieros.
  - 1.3. Los activos financieros.
  - 1.4. Los intermediarios financieros.
  - 1.5. Evolución reciente de los sistemas financieros.
2. Los activos de renta fija.
  - 2.1. Naturaleza y tipología de los activos de renta fija.
  - 2.2. La estructura temporal de los tipos de interés.
  - 2.3. La valoración de los activos de renta fija.
  - 2.4. Convexidad y duración.
  - 2.5. La inmunización y otras estrategias de inversión.
3. Los activos de renta variable.
  - 3.1. Naturaleza y tipología de los activos de renta variable.
  - 3.2. La valoración de activos de renta variable.
  - 3.3. El precio de las acciones y las decisiones financieras de la empresa.
  - 3.4. La eficiencia del mercado y sus anomalías.
  - 3.5. Las estrategias de inversión en acciones.
4. Los futuros y las opciones financieras.
  - 4.1. Naturaleza, tipología y valoración de los contratos a plazo.
  - 4.2. Naturaleza, tipología y valoración de las opciones financieras.
  - 4.3. Estrategias de especulación y cobertura.
5. Construcción y gestión de una cartera de activos financieros.
  - 5.1. Funciones y etapas de la gestión de carteras.
  - 5.3. La selección de activos y estrategias de inversión.
  - 5.4. Medición y control de resultados de una cartera.

### Programa Práctico

Programa de Prácticas:

Los activos de renta fija.  
Estructura temporal de los tipos de interés.

---

La valoración de los activos de renta fija.  
Convexidad y duración.  
La inmunización y otras estrategias de inversión.  
Los activos de renta variable.  
Naturaleza y tipología de los activos de renta variable.  
La valoración de activos de renta variable.  
Estrategias de inversión en acciones.  
Los futuros y las opciones financieras.  
La valoración de los contratos de futuros y a plazo.  
La valoración de las opciones financieras.  
Las estrategias de cobertura.  
Las estrategias de especulación.  
Construcción y gestión de una cartera de activos financieros.  
La selección de activos y estrategias de inversión.  
Medición y control de resultados de una cartera.

---

## Evaluación

La evaluación del alumno se realiza mediante un examen escrito. El examen se compone de una parte teórica (50% de la nota media) y otra práctica (50% de la nota media). Para aprobar la asignatura se requiere obtener una calificación superior a 4 en cada una de las partes (teórica y práctica) y una nota media mayor o igual que 5.

Superado el examen escrito, se podrá considerar la participación del alumno en el aula (exposición y discusión de trabajos propuestos) para mejorar la nota media obtenida en el examen.

---

## Bibliografía

---