

## I. DATOS XERAIS DA MATERIA

- |  |  |
|--|--|
| a) <b>Nome oficial.</b>                                  | Teoría e Técnicas de Investimento Financeiro |
| b) <b>Titulación.</b>                                    | ADE  |
| c) <b>Créditos</b>                                       | 4.5 (Teóricos 3; Prácticos 1.5)              |
| d) <b>Curso.</b>   | Quinto                                       |
| e) <b>Código da materia.</b>                             | 611211624                                    |
| f) <b>Tipo.</b>  | Optativa (Esp. Direcc. Financ.)              |
| g) <b>Impartición.</b>                                   | Segundo Cuatrimestre                         |
| h) <b>Departamento/s responsable/s.</b>                  | Economía Financiera e Contabilidade          |
| i) <b>Profesor/a coordinador/responsable da docencia</b> |  |

Felix R.Doldán Tié

### Información por grupo

#### 1) Nome e apelidos do profesor/a que impartirá docencia

Felix R. Doldán Tié

#### 2) Lugar e horario de titorías

#### 3) E-mail

Frdtjcn3@udc.es

#### 4) Universidade Virtual

#### 5) Lingua na que se impartirá a docencia

## II. OBXECTIVOS DA MATERIA

Aprendizaje y adquisición del conocimiento relativo a la gestión de inversiones y control de riesgos, con respecto a los diversos instrumentos financieros y carteras de los mismos.

## III. METODOLOXÍA

Será preciso el uso de Excel como herramienta de cálculo personal. El alumno deberá superar no sólo un examen teórico sino aportar una serie de trabajos que ayudarán al aprendizaje de la materia.

Será preciso el uso de Excel como herramienta de cálculo personal. El alumno deberá superar no sólo un examen teórico sino aportar una serie de trabajos

## IV. AVALIACIÓN

## V. TEMAS OU BLOQUES DE CONTIDOS

### PROGRAMA GENÉRICO:

#### PRIMERA PARTE

- INSTRUMENTOS FINANCIEROS Y CARTERAS
  - o BREVE INTRODUCCIÓN A LA TEORÍA DE CARTERAS
  - o ANÁLISIS DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS
    - RENTA VARIABLE
    - RENTA FIJA
    - DERIVADOS
      - FUTUROS Y FORWARDS
      - OPCIONES
      - SWAPS
    - PRODUCTOS ESTRUCTURADOS

#### SEGUNDA PARTE:

- GESTIÓN DEL RIESGO. CONCEPTO Y MEDICIÓN
- METODOLOGÍA DEL VALOR EN RIESGO
  - o PARA UN TÍTULO
    - ACCIÓN
    - BONO
    - FORWARD O FUTURO
    - SWAP
  - o PARA UNA CARTERA. Problema del cálculo de la asociación o dependencia entre títulos
- SISTEMAS DE ADMINISTRACIÓN DE RIESGOS.

## VI. RECOMENDACIONES

## VII. FONTES DE INFORMACIÓN

### BIBLIOGRAFÍA BÁSICA:

ALEXANDER, C. (2001). *Market Models*. J. Wiley & Sons Ltd. Chichester U.K.

ISLAM, S.M.N. y WATANAPALACHAIKUL, S. (2005). *Empirical Finance*. Physica-Verlag. New York, Melbourne.

JORION, P. (1999). *Valor en riesgo*. Limusa-Wiley. México.