

Assignatura

ANÀLISI DE MERCATS DE CAPITALS I MODELS DE GESTIÓ DE CARTERES

Curs	Cicle	Quadrimestre
1996-1997	2on	febrer-maig

PROGRAMA

Grup	Professors
01	J. Montllor / N. Orgaz
51	M.A. Tarrazon / N. Orgaz

Resum temàtic:

Estudi dels mercats financers de títols primitius i títols derivats amb especial èmfasi en les estratègies financeres.

Temes:

1. Teories del mercat de capitals (I) : C.A.P.M. i Models d'índexs.
2. Teories del mercat de capitals (II): La valoració per arbitratge (A.P.T.).
3. Selecció de carteres i anàlisi de performança.
4. Gestió de renda fixa.
5. Mercats de futurs (I) : Mercaderies i divises.
6. Mercats de futurs (II) : Índexs borsaris i taxes d'interès.
7. Mercats d'opcions (I) : Valoració d'opcions.
8. Mercats d'opcions (II) : Estratègies.
9. Swaps.
10. Inversió financera internacional.

BIBLIOGRAFIA BÀSICA

BODIE, Z. , A. KANE i J. MARCUS: Investments, 3a edició, Ed. Irwin, Homewood, Illinois, 1996.

ELTON, E.J. i M.J. GRUBER: Modern Portfolio Theory and Investment Analysis, 5a edició, Ed. John Wiley & Sons, Nova York, 1995.

HULL, J. : Introducción a los mercados de futuros y opciones, 2ª edición, Ed. Prentice-Hall, Madrid, 1996.

SHARPE, W.F., G.J. ALEXANDER i J.V. BAILEY: Investments, 5a edició, Ed. Prentice-Hall, Englewood Cliffs, 1995.

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTÀRIA

ARNOTT, R.D. i F.J. FABOZZI: Active Asset Allocation (edició revisada), Ed. McGraw-Hill, Nova York, 1996.

DE BEAUVAIS M. y E. MAINA: La Gestion Obligataire, La Revue Banque Editeur, Paris, 1996.

FABOZZI, F.J.: Bond Markets: Analysis and Strategies, 3a edició, Ed. Prentice-Hall, Englewood Cliffs, 1996.

FABOZZI, F.J. i F. MODIGLIANI: Capital Markets: Institutions and Instruments, 2a edició, Ed. Prentice-Hall, Englewood Cliffs, Nova Jersey, 1996.

FABOZZI, F.J.: Investment Management, Ed. Prentice-Hall, Englewood Cliffs, 1995.

FERNANDEZ, P.: Futuros, opciones e instrumentos derivados, Ed. Deusto, Bilbao, 1996.

GALITZ, L.: Ingeniería Financiera, (2 vols.), Ed. Folio (Financial Times), Barcelona, 1994.

GRABE, J. Orlin: International Financial Markets, 3a. edició, Ed. Prentice-Hall, Englewood-Cliffs, 1996

HULL, J.: Options, Futures and Other Derivative Securities, 3a. edició, Ed. Prentice-Hall, Englewood Cliffs, 1997.

LOFTHOUSE, S.: Equity Investment Management, Ed. John Wiley & Sons, Chichester, 1994.

OPTIONS INSTITUTE (Educational Division of the Chicago Board Options Exchange) (Ed.): Options: Essential Concepts and Trading Strategies, Ed. Business One Irwin, Homewood, Illinois, 1990.

SÁNCHEZ FERNÁNDEZ DE VALDERRAMA, J.L. (dir), Curso de bolsa y mercados financieros, Ed. Ariel, Barcelona, 1996.

SHILLER, R.J.: Market Volatility, The MIT Press, Cambridge, Massachussets, 1989.

SCHWERT, G.W. i C.W. SMITH: Empirical Research in Capital Markets, Ed. McGraw-Hill, Nova York, 1992.

TUTORIES

Prof. J. Montllor:	dilluns i dimarts d'11.30 a 13.00 h
Prof. M. A. Tarrazón:	dimecres de 15.10 a 16.10 h
	divendres de 13.15 a 15.15 h
Prof. Neus Orgaz:	dilluns de 12.00 a 13.30 h
	divendres de 12.00 a 13.30 h