

**Tema 14 Estratègies de cobertura**

1. La base.- 2. La cobertura i la base.- 3. Determinació de la cobertura.- 4. Ratio de cobertura.- 5. El mètode naïve.- 6. El model del factor de conversió.- 7. El model del punt base.- 8. El model de duració.- 9. Altres models.

**Bibliografia**

- ALEXANDER, SHARPE, Batley: *Fundamentals of Investments*, Prentice Hall, 1993.  
 -AMAT, ORIOL: *La borsa: funcionament i tècniques per a invertir*, De. Gestió 2000, 1990.  
 -BIERWAG, G.O.: *Anàlisis de la Duración*, Alianza Editorial, 1991.  
 -Bolsa de Madrid i IEAI: *Curso de introducción a bolsa*, Bolsa de Madrid, 1987.  
 -EZQUIAGA, IGNACIO: *El mercado español de deuda del estado*, Ediciones. Ariel, 1991.  
 -MARTÍN, J.L. i RUIZ, R.J.: *El inversor y los mercados financieros*, Ediciones Ariel, 1991.  
 -ONTIVEROS, E. i VALERO, F.J.: *Introducción al sistema financiero español*, Editorial Civitas, 1994.  
 -VILLAZÓN, C. i SANOU, L.: *Matemática Financiera*, Ed. Foro Científico, 1993.

**Avaluació**

L'examen constarà de dues parts: una de pràctica i una altra de teòrica.

Durant el desenvolupament del programa es proposaran alguns treballs de tipus pràctic que serviran per qualificar aquesta part i aprovar-la en el cas que els esmentats treballs hagin estat ben fets i lliurats en la data fixada. L'examen (en el sentit tradicional), consistirà a respondre un qüestionari només de tipus teòric; s'entén doncs que el treball pràctic és previ i obligatori per a tothom que vulgui aprovar aquesta assignatura.

**20279 - TÈCNIQUES D'INVESTIGACIÓ SOCIAL - ANÀLISI DE MERCATS****Programa**

*Primera part: Tècniques de mostreig*

**Tema 1 INTRODUCCIÓ****Tema 2 MÈTODES ALEATORIS**

1. Revisió de tècniques de mostreig aleatori simple.
2. L'estratificació.
3. Estimació per quocients.
4. Mostreig per conglomerats.
5. Mostreig a diferents nivells i en diferents fases.

**Tema 3 MÈTODES NO ALEATORIS****Tema 4 ELS ERRORS DE MESURA****Tema 5 LA NO RESPSTA****Tema 6 EL MOSTREIG SEQÜENCIAL**

*Segona part: Tècniques d'anàlisi multivariant*

**Tema 7 INTRODUCCIÓ****Tema 8 MÈTODES DESCRIPTIUS I (MÈTODES FACTORIALS)**

1. L'anàlisi en components principals.
2. L'anàlisi de correspondències.
3. L'anàlisi de correspondències múltiples.

**Tema 9 MÈTODES DESCRIPTIUS II**

1. Escales multidimensionals.
2. La classificació.

**Tema 10 MÈTODES EXPLICATIUS**

1. L'anàlisi discriminant.
2. La segmentació.
3. L'anàlisi de mesures conjuntes.

**Bibliografia**

- ABASCAL, E.; GRANDE, I.: *Métodos Multivariantes para la Investigación Comercial*. Ed. Ariel Económica, 1989.  
 -AZORÍN, F.; SÁNCHEZ-CRESPO, J. L.: *Métodos y Aplicaciones del Muestreo*. Ed. Alianza Universidad Textos, 1986.  
 -CUADRAS, C. M.: *Métodos de Análisis Multivariante*. Ed. PPU, 1991.  
 -CRAUSER; HARVATOPoulos; SARNIN: *Guide Practique d'Analyse des Données*. L'Edition d'organisation.  
 -ESCOFIER, B.: *Análisis factoriales simples y múltiples*. Ed. Universitat del País Basc, 1992.  
 -GOSBRAS, J. M.: *Méthodes Statistiques des Sondages*. Ed. Económica, 1987.  
 -LEBART, L.: *Tratamiento Estadístico de Datos*. Ed. Marcombo, 1985.  
 -SAPORTA, G.: *Probabilités, Analyse des Données et Statistique*. Ed. Technip, 1990.