

Curso Académico: (2021 / 2022)

Fecha de revisión: 25-11-2021

Departamento asignado a la asignatura: Departamento de Economía de la Empresa

Coordinador/a: PEÑA SANCHEZ DE RIVERA, JUAN IGNACIO

Tipo: Optativa Créditos ECTS : 6.0

Curso : 4 Cuatrimestre :

REQUISITOS (ASIGNATURAS O MATERIAS CUYO CONOCIMIENTO SE PRESUPONE)

Mathematics (Linear Algebra and Calculus), Statistics, Econometrics I and II, Microeconomics III, Financial Economics, Corporate Finance, Financial Systems

OBJETIVOS

El objetivo de este curso es que el estudiante conozca los principios que rigen el proceso de selección de cartera de inversión. Para lograr este objetivo el alumno debe adquirir una serie de conocimientos, capacidades y actitudes.

Por lo que se refiere a los conocimientos, al finalizar el curso el estudiante será capaz de:

- ¿ Sintetizar el funcionamiento de los mercados financieros y comprender las decisiones a las que se enfrentan los agentes participantes en dichos mercados.
- ¿ Entender el balance entre el riesgo y rentabilidad que debe regir como principio rector de la selección de carteras.
- ¿ Comprender el concepto de arbitraje para definir carteras óptimas en equilibrio.
- ¿ Descubrir posibles oportunidades de inversión a partir de la utilización de diversos modelos de valoración.

DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS: PROGRAMA

PROGRAM:

Chapter 1. Introduction

What is this course about?

Grading

Data and Software

Project

Asset standardized description

Chapter 2. Asset Classes, Investments Instruments, and Portfolio Performance

Asset Classes

Investment Instruments

CFD

Investment funds

ETF

Assessing Portfolio Performance

Chapter 3. Sustainable Finance

Why is sustainability important?

Traditional and sustainable finance

ESG factors

ESG Investment Strategies

Green Financial products

Chapter 4. The Elements of the Investment Strategy

Passive Investment
Active Investment
Asset Allocation
Security Selection
Market Timing

Chapter 5. Personal portfolio choice

Preliminaries
Life expectancy
Instruments
Insurance
Asset allocation
Investment funds
REITs

ACTIVIDADES FORMATIVAS, METODOLOGÍA A UTILIZAR Y RÉGIMEN DE TUTORÍAS

La metodología docente incluirá:

- (1) Clases magistrales, donde se presentarán los conocimientos que los alumnos deben adquirir. Para facilitar su desarrollo los alumnos recibirán las notas de clase y tendrán textos básicos de referencia que les permita completar y profundizar en aquellos temas en los cuales estén más interesados.
- (2) Discusión de casos reales de la actividad de gestión de carteras en las que se analizarán problemas concretos que pueden surgir en la misma.
- (3) Simulaciones en aulas informáticas en la que se pone en competición las diversas carteras de inversión diseñadas por los alumnos que se han distribuido en grupos.
- (4) Resolución de ejercicios por parte del alumno que le servirán para autoevaluar sus conocimientos y adquirir las capacidades necesarias.

SISTEMA DE EVALUACIÓN

La evaluación (continua) se basará en los siguientes criterios:

Resolución de casos y ejercicios por grupos: 40%.

Proyecto final individual 60%

Peso porcentual del Examen Final:	0
Peso porcentual del resto de la evaluación:	100