



**DENOMINACIÓN ASIGNATURA: Algoritmos de Back-Office. CURSO 2021/2022**

**MÁSTER:** Máster Universitario en Tecnologías de la Computación Aplicadas al Sector Financiero

**CURSO: 1**

SEMANA	SESIÓN	DESCRIPCIÓN DEL CONTENIDO DE LA SESIÓN	GRUPO (Marcar X)		Indicar espacio necesario distinto del aula (aula informática, laboratorio, etc..)	TRABAJO DEL ALUMNO DURANTE LA SEMANA		
			PRESENCIAL	A Distancia		DESCRIPCIÓN	HORAS PRESENCIALES	HORAS TRABAJO Semana (Máximo 7 H)
1	1	Presentación Asignatura. Tipos de entidades: Bancos, Compañías de Seguros, Gestoras Fondos, Sociedades Inversión, EAFIs, etc. Carteras de inversión. Fondos de inversión, SICAV. Inversores y partícipes. Introducción conceptos back-office:	X			Lectura de la guía docente. Bibliografía Básica. Estudio de los conceptos impartidos.	1,66	7
	2	Circuito operaciones financieras. Agenda financiera.		X		Estudio de los conceptos impartidos.	1,66	
2	3	Valoración y contabilización de inversiones. Publicación VL diario Fondos Inversión.	X			Estudio de los conceptos impartidos.	1,66	7
	4	Cumplimiento normativo Fondos Inversión. Límites y coeficientes oficiales y de folleto.		X		Desarrollo de una práctica parcial: cálculos límites de inversión.	1,66	
3	5	Medidas de rentabilidad. Performance Attribution RV. -RV Aritmético (BHB, Stockpicker, Cariño, Merchero, Dollar Attribution)	X			Análisis ejemplos prácticos reales. Estudio de los conceptos impartidos.	1,66	7

	6	Modelos Performance Attribution: RV y RF		X		Estudio de los conceptos impartidos.	1,66	
4	7	Control Riesgos: -Riesgo mercado (VaR: Paramétrico, Simulación histórica y Montecarlo)	X			Bibliografía Básica. Estudio de los conceptos impartidos	1,66	7
	8	Control Riesgos: -Riesgo crédito (rating)		X		Desarrollo de una práctica parcial: cálculo VaR.	1,66	
5	9	Control Interno Gestoras IIC -Riesgo liquidez (modelo volúmenes cruzados RV, modelo factores RF)	X			Bibliografía Básica. Estudio de los conceptos impartidos	1,66	7
	10	Depositarios y supervisión fondos de inversión		X		Bibliografía Básica. Estudio de los conceptos impartidos	1,66	
6	11	Reporting normativo. Estados reservados CNMV.	X			Bibliografía Básica. Estudio de los conceptos impartidos	1,66	7
	12	Análisis de costes de transacciones y mejor ejecución		X		Bibliografía Básica. Estudio de los conceptos impartidos	1,66	
7	13	Reporting Carteras. Estados IPEs CNMV	X			Estudio de los conceptos impartidos.	1,66	7
	14	Casos Prácticos: <i>Reporting carteras</i>		X		Repaso y preparación examen final	1,66	
<b>SUBTOTAL: 23,5 + 49 = 72,5</b>								
9		Evaluación						7
<b>TOTAL 90</b>								