Renta variable y fondos de inversión

MÁSTER UNIVERSITARIO EN BANCA Y FINANZAS

UNIVERSIDAD INTERNACIONAL MENÉNDEZ PELAYO

Másteres Universitarios

Este documento puede utilizarse como documentación de referencia de esta asignatura para la solicitud de reconocimiento de créditos en otros estudios. Para su plena validez debe estar sellado por la Secretaría de Estudiantes UIMP.

DATOS GENERALES

Título asignatura

Renta variable y fondos de inversión

Código asignatura

101051

Curso académico

2016-17

Planes donde se imparte

MÁSTER UNIVERSITARIO EN BANCA Y FINANZAS

Créditos ECTS

3

Carácter de la asignatura

OBLIGATORIA

Duración

Anual

Idioma

Castellano

CONTENIDOS

Contenidos

1. Mercado de renta variable

1.1. El mercado bursátil como fuente de financiación

1.2. El mercado bursátil como instrumento de valoración

1.3. Modelos de análisis fundamental

1.4. Gestión de carteras de renta variable

2. Fondos de inversión

2.1. Definición y funcionamiento: comparativa internacional

2.2. Estructura y esquema dentro de la entidades financieras

2.3. Tipología de fondos y sociedades por su naturaleza

2.4. Clasificación legal según las categoría de activos

2.5. Análisis de fondos de inversión: due diligence

2.6. Metodologías de selección de fondos de inversión

2.7. Ratios de performance y de rentabilidad-riesgo

2.8. Medición de riesgos y atribución de rentabilidades

2.9. Gestión de carteras con fondos de inversión

2.10. Casos prácticos: selección de categorías de fondos por nivel de riesgo y construcción de carteras modelo

RESULTADOS DE APRENDIZAJE Y DE FORMACIÓN

Generales

Instrumentales (CGI)

CGI1.- Capacidad de análisis y síntesis

CGI2.- Resolución de problemas y toma de decisiones

CGI3.- Capacidad de organización y planificación

CGI4.- Capacidad de gestionar información proveniente de fuentes diversas

CGI5.- Conocimientos avanzados de informática relativos al ámbito de estudio

Personales (CGP)

CGP6.- Habilidades interpersonales: escuchar, argumentar y debatir

CGP7.- Capacidad de liderazgo y trabajo en equipo

CGP8.- Capacidad crítica y autocrítica

CGP9.- Compromiso ético

CGP10.- Reconocimiento y respeto a la diversidad y multiculturalidad

Sistémicas (CGS)

CGS11.- Capacidad para aprender y trabajar autónomamente

CGS12.- Adaptación al cambio

CGS13.- Orientación a la acción y a la calidad

CGS14.- Capacidad de elaboración y transmisión de ideas, proyectos, informes, soluciones y problemas

CGS15.- Iniciativa y espíritu emprendedor

Específicas

CE14.- Capacidad de analizar la información pública de los mercados financieros para la toma de decisiones de inversión

PLAN DE APRENDIZAJE

Actividades formativas

Sesiones presenciales

Las sesiones en el aula de clase suponen el medio habitual de contacto en grupo entre los alumnos y su profesor, y la continuidad y la frecuencia de su carácter periódico a lo largo del curso aseguran buena parte de la interacción entre profesor y alumnos.

Dentro de las sesiones en el aula se distinguen las siguientes actividades:

AF1.- **Lecciones magistrales**: Exposición programada e ininterrumpida de contenidos por parte del profesor, a la que sigue una ronda de preguntas y dudas del alumnado.

AF3.- **Sesiones generales de presentación de contenidos**: Exposición en que el profesor explica una serie de nociones con la participación activa y colaborativa de los alumnos, que discuten y debaten los puntos oscuros o los matices que les resulten pertinentes a la correcta comprensión de los contenidos. Incluirá presentaciones dinámicas y la participación reglada o espontánea de los estudiantes por medio de actividades diversas.

AF5.- **Ejercicios y resolución de problemas**: Ejercicios y resolución de problemas planteados por el profesor a partir de una breve lectura, un material preparado para la ocasión, o cualquier otro tipo de datos o informaciones que supongan un desafío intelectual para el alumno.

AF7.- **Seminarios y talleres (casos prácticos)**: Actividades organizadas, con fijación previa de calendario o esquema temporal, plazos o fases, equipos, objetivos y resultados previstos. Están basados en la selección de materiales procedentes del mercado profesional o adaptados al mismo en la mayor medida posible, con el objeto de entrenar al alumno en la resolución de problemas reales y en la adquisición de reflejos de reacción a situaciones y planteamientos inesperados. Comúnmente se trabaja en grupo, aunque este último rasgo no es imprescindible.

Trabajo dirigido

El trabajo que los alumnos realizan fuera de clase es el complemento imprescindible del proceso de enseñanza y aprendizaje. Dirigir el trabajo de los alumnos cuando están fuera del aula y disponer de un sistema de orientación, tutoría y seguimiento de esas tareas es crucial en el conjunto del proceso. El trabajo autónomo del alumno no es necesariamente sinónimo de trabajo hecho en solitario, tal como se describe en las siguientes actividades:

AF8.- **Estudio y documentación**: Estudio individual que el estudiante realiza para comprender, reelaborar y retener un contenido científico con vistas a una posible aplicación en el ámbito de su profesión. Lectura individual de textos de diferente tipo (libros, revistas, artículos sueltos, prensa, publicaciones en Internet, informes sobre experiencias prácticas, etc.) relacionados con las materias de estudio.

Resultados de aprendizaje

- Conocer las funciones de los profesionales de analizar y seleccionar fondos de inversión y de los gestores y comercializadores.
- Conocer los diferentes planos de análisis (esfera macroeconómica, ciclo de beneficios empresariales y sentimiento de mercado).
- Identificar las especificidades concretas de los distintos segmentos del mercado de renta variable para analizar y tomar decisiones de inversión y/o cobertura.

SISTEMA DE EVALUACIÓN

Descripción del sistema de evalución

El alumno es evaluado de forma continua a través de pruebas parciales presenciales sobre el temario del programa docente, la contribución a los trabajos individuales o en equipo y la participación activa en las sesiones presenciales.

SE1.- **Examen escrito**: Ejercicio organizado de manera colectiva, con instrucciones explícitas y precisas, realizado por el alumno de forma escrita. Se pide que el examinando seleccione respuestas de entre un número dado de posibilidades, como variante o variantes correctas ante las preguntas planteadas, que responden expresamente a la finalidad de calibrar la competencia adquirida por el estudiante en los ámbitos que correspondan. Controlado mediante supervisión personal, y limitado tanto en el tiempo como, potencialmente, en los tipos, cantidades o formatos de los materiales disponibles para el alumno.

- Ponderación mínima 50 % y máxima 80 %

SE4.- **Participación activa del alumno en el aula**: Participación, búsqueda de información adicional, reflexión para la toma de posición personal sobre temas concretos, proactividad, etc. valorándose por parte del profesor de la materia tanto las aportaciones como las actitudes del alumno, fruto de un proceso de aprendizaje relacionado con las competencias definidas para la materia.

- Ponderación mínima 10 % y máxima 15 %

PROFESORADO

Profesor responsable

Manzano Romero, Daniel

Doctor en Ciencias Económicas y Empresariales
Presidente de Afi Inversiones Financieras Globales EAFI

Profesorado

Ruiz Rodríguez, Alberto

Abogado
Managing Director en Omega Gestión de Inversiones SGIIC

Cano Martínez, David

Doctor en Economía Financiera
Director General de Analistas Financieros Internacionales
Inversiones Financieras Globales, EAFI