

MASTER		Master en Data Science para Finanzas	
ASIGNATURA		GESTIÓN DE ACTIVOS Y DE CARTERAS	
Nº de ECTS		2	
Nº de horas docentes		15	
Nº de horas actividades académicas dirigidas			
Profesor responsable de la asignatura		Fernando Sánchez Santidrián	
Cuatrimestre		2º Cuatrimestre	

**1.- DESCRIPCIÓN GENERAL DE LA ASIGNATURA Y OBJETIVOS DE DOCENCIA:**

**2.- FORMA DE EVALUACIÓN PREVISTA:**

Participación y asistencia	25%
Actividades académicas dirigidas	25%
Prueba objetiva final	50%

**PROGRAMA DETALLADO**

Nº de sesión	Detalle del contenido docente: temas, casos prácticos, actividades académicas dirigidas que se verán en dicha sesión,...	Lecturas recomendadas o referencias bibliográficas relativas a los conceptos-temas desarrollados en la sesión
1	Introducción a la gestión de activos y construcción de carteras	<i>New trends in Asset Management</i> Thierry Roncalli
2	<i>Orígenes e historia de la aplicación de métodos de Data Science en la gestión de activos</i>	<i>Big Data and Investment Management</i> , BNY Mellon <i>Big Data &amp; Investment Management: The Potential to Quantify Traditionally Qualitative Factors</i> Citi Business Adv Services
3	Aplicación en estrategias de gestión pasiva (sesión teórica)	<i>Harnessing the power of Big Data</i> Goldman Sachs
4	Aplicación en estrategias de gestión pasiva (sesión práctica)	
5	Aplicación en estrategias de gestión alternativa: estrategias de L/S Equity y Stat Arb (sesión teórica)	<i>Big data Big Alpha.</i> Blackrock

6	Aplicación en estrategias de gestión alternativa: estrategias de L/S Equity y Stat Arb (sesión práctica)	
7	Aplicación en estrategias de gestión alternativa: estrategias de seguimientos de tendencias (CTAS) (sesión teórica)	<a href="https://www.blackrockblog.com/2015/07/21/conference-calls-relationship-to-stock-trends/">https://www.blackrockblog.com/2015/07/21/conference-calls-relationship-to-stock-trends/</a> <i>AIMS Perspective_Jan2017</i> Pag 54-61 Goldman Sachs
8	Aplicación en estrategias de gestión alternativa: estrategias de seguimientos de tendencias (CTAS) (sesión práctica)	
9	Métodos de selección de fondos basados en data science	<i>AIMS Perspective_Jan2017</i> Pag 26-28 Goldman Sachs
10	Inclusión de este tipo de gestión en una cartera.	

**INFORMACION ADICIONAL**

<b>Bibliografía básica</b>	
<b>Bibliografía Complementaria</b>	
<b>Actividades Complementarias</b>	
<b>Localización del profesor</b>	<b>fernando.sanchez@cunef.edu</b>