

PROGRAMA DE POSTGRADO	PROGRAMA EJECUTIVO EN BOLSA Y GESTIÓN DE INVERSIONES
ASIGNATURA	Análisis e información de mercados financieros
Nº de ECTS	2
Nombre del profesor/es	Prof. Juan Jose Tenorio/Rafael Hurtado
Cuatrimestre	Primero
Horas de tutoría	Después de cada sesión, el profesor se quedará para atender posibles dudas o preguntas. Además, mediante cita previa, los alumnos podrán, si lo necesitan, tener tutorías en Cunef, de 13:30 a 15:30 horas.
Correo electrónico del profesor	jtenorioblazquez@cunef.edu , rhurtadocoll@cunef.edu

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

El seminario tiene como objetivo la familiarización por parte del alumno de los principales sistemas de información financiera, es especial de Bloomberg, aunque también de otros sistemas.

El alumno comprenderá el manejo de herramientas como Bloomberg y cómo los profesionales utilizan dichas herramientas.

Los objetivos de aprendizaje de la asignatura son:

- Conocer los fundamentos de las principales fuentes de información financiera (Bloomberg, Reuters, etc)
- Comprender el uso de información financiera aplicado a la renta fija
- Comprender el uso de información financiera aplicado a la renta variable
- Comprender el uso de información financiera aplicado a los derivados
- Comprender el uso de información financiera aplicado a la selección de fondos
- Comprender el uso de información financiera aplicado a la macroeconomía
- Programación en Excel con datos de Bloomberg

2.- FORMA DE EVALUACIÓN PREVISTA:

Asistencia y participación:	La asistencia y participación activa habitual es fundamental. Pesará un 20% de la nota final.
Actividades académicas dirigidas:	Se realizará un trabajo en Grupo con un peso de un 80% de la nota final.
Restricciones:	Con independencia de la nota de la evaluación continua, para aprobar la asignatura es imprescindible que el alumno obtenga, como mínimo, una nota de 5 en el trabajo final

Prueba objetiva final (Extraordinaria):	En la convocatoria extraordinaria se realizará un trabajo individual con un peso del 100%
--	---

PROGRAMA DOCENTE DETALLADO		
Nº de sesión	Detalle del contenido docente: temas, conceptos que serán tratados y /o de las actividades que se desarrollarán en la sesión (casos prácticos, supuestos,...)	Lecturas recomendadas: Notas técnicas, material audiovisual y/o referencias bibliográficas relativas a los conceptos-temas que serán desarrollados en la sesión.
1	Introducción a las fuentes de información financiera	Manuales de Bloomberg y presentación del profesor
2	Análisis de la renta fija y macroeconomía	Manuales de Bloomberg y documentación elaborada por el profesor
3	Análisis de renta variable	Manuales de Bloomberg y documentación elaborada por el profesor
4	Análisis de fondos y de derivados	Manuales de Bloomberg y documentación elaborada por el profesor
5	Vinculación y programación en Excel vinculado a Bloomberg	Manuales de Bloomberg y documentación elaborada por el profesor
6	Presentación de trabajos finales	Presentaciones de los alumnos

Sesión 1. Introducción a las fuentes de información financiera

Durante la sesión 1 se analizarán las diferentes fuentes de información que utilizan los profesionales (Bloomberg, Reuters, Factset, etc). Se analizarán las ventajas e inconvenientes de cada una de estas herramientas.

Sesión 2. Análisis de renta fija y macroeconomía

En la sesión 2 se profundizará en la obtención y análisis de los datos que se utilizan para el análisis macroeconómico y la gestión de la renta fija (análisis de bonos, curvas de tipos, spread de créditos...)

Sesión 3. Análisis de renta variable

Durante esta sesión se analizarán la obtención de datos para la gestión de renta variable, haciendo hincapié en recomendaciones de analistas, ratios de valoración y cálculos como el WACC o la beta.

Sesión 4. Análisis de fondos y derivados

En la sesión 4 se analizará la obtención de datos para el análisis de fondos y derivados. En el caso de fondos, los criterios cualitativos y cuantitativos serán revisados, explicando las fuentes de información. En cuanto a derivados se expondrá cómo obtener precio de los mismo y cómo se realiza su análisis (por ejemplo, el de las griegas)

Sesión 5. Vinculación y programación en Excel vinculado a Bloomberg

En la sesión 5 se comprenderá las vinculaciones entre Excel en Bloomberg así como la programación en Excel. Se revisarán las diferentes plantillas de Bloomberg vinculadas a Excel..

Sesión 6. Presentación de trabajos finales

Los alumnos deberán presentar trabajos en grupos que serán evaluados. Se analizará un fondo, una acción y un bono.

Bibliografía básica	La bibliografía básica se centra en diferentes manuales de Bloomberg que serán distribuidos a los alumnos además de diferentes presentaciones y documentos elaborados por el profesor.
Bibliografía Complementaria	Diversas páginas web donde se podrá encontrar información financiera y análisis.