

Programación semanal

En la programación semanal te presentamos un **reparto del trabajo de la asignatura** a lo largo de las semanas del cuatrimestre.

	CONTENIDO TEÓRICO	ACTIVIDADES (15 puntos)	CLASES EN DIRECTO
Semana 1	Tema 1. Construcción de carteras 1.1. Introducción y objetivos 1.2. Tipos de carteras y procesos de inversión 1.3. Estilos de inversión 1.4. Asignación estratégica y asignación táctica		Sesión de Presentación de la asignatura Clase del Tema 1
Semana 2	Tema 1. Construcción de carteras (continuación) 1.5. Métodos de construcción de una cartera	Test Tema 1 (0,1 punto)	Clase del Tema 1
Semana 3	Tema 2. Teoría del factor 2.1. Introducción y objetivos 2.2. Modelo CAPM 2.3. Modelos APT 2.4. La inversión por factores 2.5. Referencias bibliográficas	Test Tema 2 (0,1 punto)	Clase del Tema 2
Semana 4	Tema 3. Medidas de riesgo de una cartera 3.1. Introducción y objetivos 3.2. Medidas de dispersión 3.3. Covarianza y correlación 3.4. VaR		Clase del Tema 3
Semana 5	Tema 3. Medidas de riesgo de una cartera (continuación) 3.5. Otras medidas de riesgo 3.6. Riesgos no cuantitativos 3.7. Referencias bibliográficas	Entrega Actividad 1 (4 puntos) Test Tema 3 (0,1 punto)	Clase del Tema 3
Semana 6	Tema 4. Presupuesto de riesgo 4.1. Introducción y objetivos 4.2. Medidas cuantitativas y cualitativas para el presupuesto de riesgo 4.3. Diseño del presupuesto de riesgo 4.4. Utilidad del presupuesto de riesgo 4.5. Referencias bibliográficas	Test Tema 4 (0,1 punto)	Clase del Tema 4

	CONTENIDO TEÓRICO	ACTIVIDADES (15 puntos)	CLASES EN DIRECTO
Semana 7	Tema 5. Monitoreo de riesgos y medición del desempeño 5.1. Introducción y objetivos 5.2. Medias de rentabilidad 5.3. Medidas de riesgo 5.4. Medidas de rentabilidad-riesgo 5.5. Referencias bibliográficas	Entrega Actividad 2 (4 puntos) Test Tema 5 (0,1 punto)	Clase de Resolución de la Actividad 1 Clase del Tema 5
Semana 8	Tema 6. Análisis del desempeño basado en cartera 6.1. Introducción y objetivos 6.2. Proceso de análisis de carteras 6.3. Proceso de análisis cuantitativo		Clase del Tema 6
Semana 9	Tema 6. Análisis del desempeño basado en cartera (continuación) 6.4. Proceso de análisis cualitativo 6.5. Consejos para evaluar carteras 6.6. Referencias bibliográficas	Actividad grupal Lectura individual Test Tema 6 (0,1 punto)	Clase de Resolución de la Actividad 2 Clase del Tema 6
Semana 10		Actividad grupal Aula de discusión	Presentación de la Actividad Grupal
Semana 11	Tema 7. Hedge funds (fondos de cobertura) I 7.1. Introducción y objetivos 7.2. Definición de <i>hedge funds</i> 7.3. Características de los <i>hedge funds</i>	Test Tema 7 (0,1 punto)	Sesión de Recomendación de Examen Clase del Tema 7
Semana 12		Entrega de Actividad Grupal (6,2 puntos)	Clase de Resolución de Actividad Grupal
Semana 13	Tema 7. Hedge funds (fondos de cobertura) I (continuación) 7.4. Diferencias entre gestión tradicional y <i>hedge funds</i> 7.5. Referencias bibliográficas		Clase del Tema 7

	CONTENIDO TEÓRICO	ACTIVIDADES (15 puntos)	CLASES EN DIRECTO
Semana 14	Tema 8. Hedge funds (fondos de cobertura) II 8.1. Introducción y objetivos 8.2. Estrategias y estilos de gestión de los <i>hedge funds</i> 8.3. Riesgos generales de los <i>hedge funds</i> 8.4. Riesgos específicos de los <i>hedge funds</i> 8.5. Proceso de <i>due diligence</i>	Test Tema 8 (0,1 punto)	Clase del Tema 8
Semana 15	Clase de Repaso		
Semana 16	Semana de exámenes		

NOTA

Esta **Programación semanal** puede ser modificada si el profesor lo considera oportuno para el enriquecimiento de la asignatura.