

6-07

# GUÍA DE ESTUDIO DE LDI



## **MATEMATICAS DE LAS OPERACIONES FINANCIERAS II**

CÓDIGO 01423082

UNED

6-07

MATEMATICAS DE LAS OPERACIONES  
FINANCIERAS II  
CÓDIGO 01423082

# ÍNDICE

OBJETIVOS

CONTENIDOS

EQUIPO DOCENTE

BIBLIOGRAFÍA BÁSICA

BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA

SISTEMA DE EVALUACIÓN

HORARIO DE ATENCIÓN AL ESTUDIANTE

## OBJETIVOS

Proporcionar a los alumnos los conocimientos necesarios para el estudio y la resolución de cualquier clase de operación financiera a largo plazo que pueda plantearse, tanto en el plano teórico como en el práctico.

## CONTENIDOS

El contenido se estructura en tres partes suficientemente diferenciadas:

La parte primera se dedica al estudio de las operaciones de amortización de capital, analizándose su planteamiento general y los casos particulares de utilización más frecuente en la práctica, incluyéndose también los préstamos hipotecarios y los sindicados. (Temas 1 al 4).

La parte segunda estudia las distintas modalidades de empréstitos desde la perspectiva de la empresa emisora. También se analizan desde la perspectiva de los obligacionista. (Temas 5 al 8).

En la parte tercera se estudian otras operaciones financieras, tales como las de constitución de capital, de arrendamiento financiero, de inversión, actuariales, etc. (Temas 9 al 15).

La relación de temas y el título de cada uno de ellos es:

### Parte Primera: Préstamos

TEMA 1. Préstamos: planteamiento general y casos particulares  
TEMA 2. Otras modalidades de préstamos (I)  
TEMA 3. Otras modalidades de préstamos (II)  
TEMA 4. Valor financiero del préstamo. Tantos efectivos

### Parte Segunda: Empréstitos

TEMA 5. Empréstitos: Aspectos generales. Deuda Pública. Amortización por reducción del nominal

TEMA 6. Empréstitos normales que se amortizan por sorteo

TEMA 7. Empréstitos con características comerciales

TEMA 8. Los empréstitos desde la perspectiva del inversor-obligacionista

### Parte Tercera: Otras operaciones financieras

TEMA 9. Operaciones de constitución de capital

TEMA 10. Otras operaciones de financiación

TEMA 11. Operaciones de inversión

TEMA 12. Operaciones con valores mobiliarios

TEMA 13. El riesgo en las carteras de renta fija.

TEMA 14. Introducción a las operaciones actuariales.

TEMA 15. La inflación en las operaciones financieras.

## EQUIPO DOCENTE

Nombre y Apellidos

Correo Electrónico

Teléfono

Facultad

Departamento

DAMIAN DE LA FUENTE SANCHEZ

dfuente@cee.uned.es

91398-6349

FAC.CIENCIAS ECONÓMICAS Y EMPRESARIALES

ECONOMÍA DE LA EMPRESA Y CONTABILIDAD

Nombre y Apellidos

Correo Electrónico

Teléfono

INMACULADA PRA MARTOS

ipra@cee.uned.es

91398-6371

Facultad	FAC.CIENCIAS ECONÓMICAS Y EMPRESARIALES
Departamento	ECONOMÍA DE LA EMPRESA Y CONTABILIDAD
Nombre y Apellidos	MONTSERRAT HERNANDEZ SOLIS
Correo Electrónico	montserrath@cee.uned.es
Teléfono	91398-9371
Facultad	FAC.CIENCIAS ECONÓMICAS Y EMPRESARIALES
Departamento	ECONOMÍA DE LA EMPRESA Y CONTABILIDAD

## BIBLIOGRAFÍA BÁSICA

### Teoría:

PABLO LÓPEZ, A. de: *Matemática de las Operaciones Financieras II* (Unidades Didácticas). Editorial UNED, 2002.

### Práctica:

PABLO LÓPEZ, A. de: *Manual Práctico de Matemática Comercial y Financiera*, vol. II. Editorial Centro de Estudios Ramón Areces. Madrid, 2001.

## BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA

BORREL VIDAL, M., y otros: *Estadística Financiera. Aplicación a la formación y gestión de carteras de renta variable*. Ed. Centro de Estudios Ramón Areces. Madrid, 1997.

BREALEY-MYERS: *Fundamentos de Financiación Empresarial*. McGraw-Hill. Madrid, 1988.

COSTA RAN, L., y FONT, M.: *Nuevos Instrumentos Financieros en la Estrategia Empresarial: Opciones, Swaps, Futuros, Fras, Caps, Collars*. Ed. Esic. Madrid, 1992.

CÓRDOBA BUENO, M.: *Análisis financiero de los mercados monetarios y de valores*. Ed. AC. 1996.

FRANCIS, y ARCHER: *Análisis y Gestión de Carteras de Valores*. Ed. ICE. Madrid, 1977.

GIL PELÁEZ, L.: *Matemática de las Operaciones Financieras*. Ed. AC. Madrid, 1987.

GIL PELÁEZ, L., y otros: *Matemática de las Operaciones Financieras: Problemas resueltos*. Ed. AC. Madrid, 1987.

GONZÁLEZ CATALA, V. T.: *Enfoque práctico de las Operaciones de la Matemática Financiera*. Ed. Ciencias Sociales. Madrid, 1991.

–*Análisis de las Operaciones Financieras, Bancarias y Bursátiles*. Ed. Ciencias Sociales. Madrid, 1992.

LAMOTHE, P.: *Opciones Financieras*. McGraw-Hill. Madrid, 1993.

LEVI, E.: *Curso de Matemática Financiera y Actuarial*. Ed. Bosch. Barcelona, 1973.

MAO, J.: *Análisis Financiero*. Ed. El Ateneo. Buenos Aires, 1974.

MARTIN, M., y otros: *La operativa en los mercados financieros*. Ed. Ariel. Barcelona, 1995.

MENEU FERRER, V., y otros: *Análisis y Gestión del Riesgo de Interés*. Ed. Ariel. Barcelona, 1992.

- MENEU FERRER, V., y otros: *Operaciones Financieras en el Mercado Español*. Ed. Ariel. Barcelona, 1994.
- ONTIVEROS, E., y otros: *Mercados Financieros Internacionales*. Ed. Espasa Calpe. 1991.
- PABLO LÓPEZ, A. de: *Valoración Financiera*. Ed. Ramón Areces. Madrid, 1998.
- PABLO LÓPEZ, A. de, y FERRUZ, L.: *Finanzas de Empresa*. Ed. Centro de Estudios Ramón Areces. Madrid, 1997.
- PABLO LÓPEZ, A. de, y otros: *Análisis Práctico de Decisiones de Inversión y Financiación en la Empresa*. Ed. Ariel. Barcelona, 1990.
- PRIETO PÉREZ, E.: *Análisis Financiero de los Empréstitos-Obligaciones*. ICE Ediciones. Madrid, 1982.
- RODRÍGUEZ RODRÍGUEZ, A.: *Matemática de la Financiación*. Ed. Universidad de Barcelona, 1994.
- RUIZ AMESTOY, J. M.: *Matemática Financiera*. Ed. Centro de Formación del Banco de España. Madrid, 1993.
- SOLDEVILLA, E.: *Opciones y futuros sobre tipos de interés a corto plazo*. Ed. Piramide, 1997.
- SUÁREZ SUÁREZ, A. S.: *Decisiones Óptimas de Inversión y Financiación*. Ed. Pirámide. Madrid, 1993.

## SISTEMA DE EVALUACIÓN

### 8.1. PRUEBAS DE EVALUACIÓN A DISTANCIA

La elaboración de los Cuadernillos de evaluación a distancia no es obligatoria para el alumno aunque se recomienda su realización para que él mismo pueda contrastar su grado de preparación en cada una de las partes. Se pueden encontrar en la página web de la asignatura.

De forma complementaria, el alumno, debe resolver los ejercicios de autoevaluación que figuran en las Unidades Didácticas al final de cada tema.

### 8.2. TRABAJOS DE PRÁCTICAS

No se propone ninguno para el curso 2005-2006.

### 8.3. PRUEBAS PRESENCIALES

La Prueba Presencial comprende los temas 1 al 15 del programa e incluirá, como mínimo, una pregunta sobre préstamos, otra sobre empréstitos, y una tercera referente al resto del contenido; unas serán de tipo teórico y otras de tipo práctico.

Los alumnos sólo podrán emplear como elemento auxiliar la calculadora, cuya utilización es imprescindible para resolver la parte práctica.

Las calificaciones obtenidas por cada alumno se podrán consultar en el servicio de mensajería telefónica de que dispone la UNED, que funciona las 24 horas, tres semanas después de que hayan finalizado las pruebas presenciales.

El enunciado de la prueba presencial y las soluciones a las preguntas prácticas se podrán

consultar en la página web de Internet que tiene esta asignatura dentro del Departamento de Economía de la Empresa y Contabilidad.

#### **8.4. INFORMES DEL PROFESOR-TUTOR**

Dado que una parte de nuestros alumnos no pueden acudir a las tutorías, los informes de los profesores tutores se referirán preferentemente al nivel de cumplimiento de las pruebas de evaluación a distancia. Al ser estas de carácter voluntario no se tendrán en cuenta en la calificación final.

#### **8.5. CRITERIOS GENERALES PARA LA EVALUACIÓN FINAL**

En la prueba presencial, al final del enunciado de examen, se indica la puntuación que se asigna a cada pregunta; de esta manera, cada alumno puede contrastar lo que ha contestado con las explicaciones que figuran en las Unidades Didácticas; por otra parte, las soluciones a las preguntas de tipo práctico, se pueden consultar en la página web antes indicada. En consecuencia, cada alumno puede realizar una estimación bastante aproximada de la calificación que obtendrá.

La revisión de exámenes se efectuará en el horario de consulta de la asignatura, bien sea por presencia directa del alumno, por teléfono, por escrito o por correo electrónico.

## **HORARIO DE ATENCIÓN AL ESTUDIANTE**

### **D. Andrés de Pablo López**

Despacho 107 Jueves, de 16 a 20 h. Tel.: 91 398 63 80 Correo electrónico: apablo@cee.uned.es

### **D. Damián de la Fuente Sánchez**

Despacho 106 Jueves, de 16 a 20 h. Tel.: 91 398 63 49 Correo electrónico: dfuente@cee.uned.es

### **D.<sup>a</sup> Inmaculada Pra Martos**

Despacho 106

Jueves, de 16 a 20 h.

Tel.: 91 398 63 71

Correo electrónico: ipra@cee.uned.es

Lugar: Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales, 1.<sup>a</sup> planta. Paseo Senda del Rey n.º 11. Ciudad Universitaria 28040 Madrid.

Las consultas telefónicas para la revisión de exámenes se efectuarán a los números 91 398 63 49 y 91 398 63 71.

Para las comunicaciones postales escribir a la dirección:

UNED

Facultad de CC Económicas y Empresariales

Dpto. Economía de la Empresa y Contabilidad

Matemática de las Operaciones Financieras

(Despachos 106 ó 107)

Apartado de Correos 60.142 - 28080 MADRID

En el supuesto de que se utilice el correo electrónico se ruega enviar el mensaje a uno solo de los profesores, incluyendo su número de teléfono para poderle contestar por esta vía en

el caso de que fuera conveniente.

## **OTROS MATERIALES**

No se han elaborado vídeos, casetes, CD-ROM, etc.

## **OTROS MEDIOS DE APOYO**

–*Página web*: La asignatura dispone de una página web propia en la dirección:

<http://www.uned.es/dpto-eeyc> con el objetivo de servir de ayuda para la preparación de la asignatura. En ella se pueden encontrar desde orientaciones para su estudio, hasta un foro de debate, pasando por pruebas de autoevaluación online, exámenes, pruebas de autoevaluación o preguntas más frecuentes (FAQ). –*Programas de radio*: Al inicio del curso, y de acuerdo con el calendario que establezca el decanato de la Facultad se emitirá información relacionada con esta asignatura. –*Videoconferencia*: Se atenderán las solicitudes que formulen los Centros Asociados que dispongan de este medio de comunicación. –*Correo electrónico*: Los profesores tutores y los alumnos pueden utilizar este medio de comunicación cuando lo consideren oportuno. Las direcciones del equipo docente figuran en el epígrafe 9.

---

## **IGUALDAD DE GÉNERO**

En coherencia con el valor asumido de la igualdad de género, todas las denominaciones que en esta Guía hacen referencia a órganos de gobierno unipersonales, de representación, o miembros de la comunidad universitaria y se efectúan en género masculino, cuando no se hayan sustituido por términos genéricos, se entenderán hechas indistintamente en género femenino o masculino, según el sexo del titular que los desempeñe.