10-11

GUÍA DE ESTUDIO DE LDI



MATEMATICAS DE LAS OPERACIONES FINANCIERAS II

CÓDIGO 01423082

UNED

10-11

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 16 al 19).

•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 20 al 23).

•En la parte tercera se estudian otras operaciones financieras, tales como las de constitución de capital, de arrendamiento financiero, de inversión, actuariales, etc. (Temas 24 al 30).

Los contenidos que serán objeto de examen se ajustan al texto utilizado como bibliografía básica (teoría) de acuerdo con el siguiente esquema:

Tema 16: Préstamos: Planteamiento general y casos particulares

Tema 17: Otras modalidades de préstamos (I)

Tema 18: Otras modalidades de préstamos (II)

•No será objeto de examen el epígrafe 18.5 (amortización con los intereses anticipados).

Tema 19: Valor financiero del préstamo. Tantos efectivos

•No son objeto de examen los epígrafes 19.5 (valor del préstamo con los intereses fraccionados) y 19.6 (valor del préstamo con los intereses anticipados).

Tema 20: Empréstitos. Aspectos generales

Tema 21: Empréstitos normales que se amortizan por sorteo

•No son objeto de examen los epígrafes 21.4 (empréstitos con pago de cupones anticipados) y 21.6 (empréstitos con pago fraccionado de intereses).

Tema 22: Empréstitos con características comerciales

•No son objeto de examen los epígrafes 22.2.2 (empréstitos normalizables al tipo II) y 22.2.3 (empréstitos normalizables al tipo III).

Tema 23: Los empréstitos desde la perspectiva del inversor-obligacionista

•No es objeto de examen el epígrafe 23.3 (empréstitos a tanto de rendimiento constante).

Tema 24: Operaciones de constitución de capital

•No son objeto de examen los epígrafes 24.2.2.2 (constitución con cuotas de constitución constantes) y 24.3.2.2 (constitución con cuotas de constitución constantes.

Tema 25: Otras operaciones de financiación

•No es objeto de examen el epígrafe 25.2 (financiación de las cuentas a cobrar).

•No es objeto de examen el anexo de este tema.

Tema 26: Operaciones de inversión

•No será objeto de examen el tema al completo.

Tema 27: Operaciones con valores mobiliarios

•No será objeto de examen el tema al completo

Tema 28: El riesgo en las carteras de renta fija

Tema 29: Introducción a las operaciones actuariales

•No será objeto de examen el tema al completo.

Tema 30: La inflación en las operaciones financieras

•No son objeto de examen los epígrafes 30.5 (préstamos con duración variable), 30.6 (empréstitos), 30.7 (operaciones indizadas) y 30.8 (empréstitos participantes).

EQUIPO DOCENTE

Nombre y Apellidos	DAMIAN DE LA FUENTE SANCHEZ
Correo Electrónico	dfuente@cee.uned.es
Teléfono	91398-6349
Facultad	FAC.CIENCIAS ECONÓMICAS Y EMPRESARIALES
Departamento	ECONOMÍA DE LA EMPRESA Y CONTABILIDAD

Nombre y Apellidos	INMACULADA PRA MARTOS
Correo Electrónico	ipra@cee.uned.es
Teléfono	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

ISBN(13):9788436240580

Título:MATEMÁTICAS DE LAS OPERACIONES FINANCIERAS II. VOL. II. PRÉSTAMOS. EMPRÉSTITOS. OTRAS OPERACIONES FINANCIERAS (3ª)

Autor/es:Pablo López, Andrés De ;

Editorial:U.N.E.D.

ISBN(13):9788480044639

Título:MANUAL PRÁCTICO DE MATEMÁTICA COMERCIAL Y FINANCIERA. VOL. II (2ª)
Autor/es:Pablo López, Andrés De ;
Editorial:CERA

BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA

ISBN(13):9788448100681
Título:OPCIONES FINANCIERAS (1ª ED., 1ª REIMP.)
Autor/es:Lamothe Fernández, Prosper ;
Editorial:MC GRAW HILL

ISBN(13):9788473560757
Título:NUEVOS INSTRUMENTOS FINANCIEROS
Autor/es:Font Vilalta, Montserrat ; Costa Ran, Luis ;
Editorial:ESIC EDITORIAL (ESIC)

ISBN(13):9788480045094
Título:VALORACIÓN FINANCIERA (3ª)
Autor/es:Pablo López, Andrés De ;
Editorial:CERA

BORREL VIDAL, M., y otros (1997): *Estadística Financiera. Aplicación a la formación y gestión de carteras de renta variable.* Ed. Centro de Estudios Ramón Areces. Madrid.
BREALEY-MYERS (1988): *Fundamentos de Financiación Empresarial.* McGraw-Hill. Madrid.
COSTA RAN, L., y FONT, M. (1992): *Nuevos Instrumentos Financieros en la Estrategia Empresarial: Opciones, Swaps, Futuros, Fras, Caps, Collars.* Ed. Esic. Madrid.
CÓRDOBA BUENO, M. (1996): *Análisis financiero de los mercados monetarios y de valores.* Ed. AC. Madrid.
FRANCIS, y ARCHER (1977): *Análisis y Gestión de Carteras de Valores.* Ed. ICE. Madrid.
GIL PELÁEZ, L. (1987): *Matemática de las Operaciones Financieras.* Ed. AC. Madrid.
GIL PELÁEZ, L., y otros (1987): *Matemática de las Operaciones Financieras: Problemas resueltos.* Ed. AC. Madrid.
GONZÁLEZ CATALÁ, V.T. (1992): *Análisis de las Operaciones Financieras, Bancarias y Bursátiles.* Ed. Ciencias Sociales. Madrid.
GONZÁLEZ CATALA, V. T. (1991): *Enfoque práctico de las Operaciones de la Matemática Financiera.* Ed. Ciencias Sociales. Madrid.
LAMOTHE, P. (1993): *Opciones Financieras.* McGraw-Hill. Madrid.
LEVI, E. (1973): *Curso de Matemática Financiera y Actuarial.* Ed. Bosch. Barcelona.
MAO, J. (1974): *Análisis Financiero.* Ed. El Ateneo. Buenos Aires.
MARTIN, M., y otros (1995): *La operativa en los mercados financieros.* Ed. Ariel. Barcelona.

MENEU FERRER, V., y otros (1992): *Análisis y Gestión del Riesgo de Interés.* Ed. Ariel. Barcelona,.
MENEU FERRER, V., y otros (1994): *Operaciones Financieras en el Mercado Español.* Ed. Ariel. Barcelona.
ONTIVEROS, E., y otros (1991): *Mercados Financieros Internacionales.* Ed. Espasa Calpe.
PABLO LÓPEZ, A. de (2002): *Valoración Financiera.* Ed. Ramón Areces. 3ª edición. Madrid.
PABLO LÓPEZ, A. de, y FERRUZ, L. (1997): *Finanzas de Empresa.* Ed. Centro de Estudios Ramón Areces. Madrid.
PABLO LÓPEZ, A. de, y otros (1990): *Análisis Práctico de Decisiones de Inversión y Financiación en la Empresa.* Ed. Ariel. Barcelona.
PRIETO PÉREZ, E. (1982): *Análisis Financiero de los Empréstitos-Obligaciones.* ICE Ediciones. Madrid.
RODRÍGUEZ RODRÍGUEZ, A. (1994): *Matemática de la Financiación.* Ed. Universidad de Barcelona.
RUIZ AMESTOY, J. M. (1993): *Matemática Financiera.* Ed. Centro de Formación del Banco de España. Madrid.
SOLDEVILLA, E. (1997): *Opciones y futuros sobre tipos de interés a corto plazo.* Ed. Piramide. Madrid.
SUÁREZ SUÁREZ, A. S. (1993): *Decisiones Óptimas de Inversión y Financiación.* Ed. Pirámide. Madrid.

SISTEMA DE EVALUACIÓN

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 (http://www.uned.es/dpto-eeyc/)

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

PRUEBAS PRESENCIALES

La Prueba Presencial comprende los temas 16 al 30 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 mensajeria telefónica de que dispone la UNED o bien a través de la secretaría virtual en internet 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.

INFORMES DEL PROFESOR-TUTOR

Dado que una parte de nuestros alumnos no pueden acudir a las tutorias, 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.

CRITERIOS GENERALES PARA LA EVALUACIÓN FINAL

En el 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, el 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

El Horario de atención es el siguiente:

Todos los jueves lectivos desde las 16.00 horas hasta las 20.00 horas a través de los siguientes medios

•Profesor Andrés de Pablo López

- Teléfono: 91 - 398.6380 / Fax: 91 - 398.6341 - Correo electrónico: apablo@cee.uned.es - Personalmente: Despacho 1.07 (Facultad de Económicas)

•Profesor Damián de la Fuente Sánchez

- Teléfono: 91 - 398.6349 / Fax: 91 - 398.6341 - Correo electrónico: dfuente@cee.uned.es - Personalmente: Despacho 1.06 (Facultad de Económicas)

•Profesora Inmaculada Pra Martos

- Teléfono: 91 - 398.6371 / Fax: 91 - 398.6341 - Correo electrónico: ipra@cee.uned.es - Personalmente: Despacho 1.06 (Facultad de Económicas)

•Profesora Montserrat Hernández Solís

- Teléfono: 91 - 398.9371 / Fax: 91 - 398.6341 - Correo electrónico: montserrath@cee.uned.es - Personalmente: Despacho 1.06 (Facultad de Económicas)

En el caso de comunicaciones postales, la dirección es:

UNED / Facultad de Ciencias EconómicasC/ Senda del Rey, 1128.040 - 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 MEDIOS DE APOYO

Además del curso virtual correspondiente, la asignatura dispone de un espacio en la página web del departamento (http://www.uned.es/dpto-eeyc/) que pretende servir de ayuda para la

preparación de la asignatura. En ella se pueden encontrar orientaciones para su estudio, exámenes, pruebas de autoevaluación y preguntas más frecuen-tes (FAQ). Otros medios que el alumno tiene a su disposición son los siguientes:

- 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.

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.