

Anexos



Bibliografía de trabajos seminales en finanzas

BIBLIOGRAFÍA:

- Abello, Javier, Oller, Jordi Y VILA, Jordi. *Introducción a las opciones financieras*. Eada Gestión.
- Adell, Ramón y Ketterer, Joan Antoni. *Gestión de tesorería con futuros financieros*. Editorial Gestión, 2000.
- Adell, Ramón y Romeo, Remedios. *Opciones y futuros financieros*. Pirámide.
- Allen, F. and D. Gale. *Financial Innovation and Risk Sharing*. Cambridge: MIT Press, 1994.
- Allen, Steve L. *Financial Risk Management: A Practitioner's Guide to Managing Market and Credit Risk* (with CD-ROM).
- Arrow, K. J. *Essays in the Theory of Risk Bearing*. North Holland, Amsterdam. 1971.
- Arrow, K. J. "The role of securities in the optimal allocation of Risk Bearing", in *Review of Economic Studies*, Vol. 31, No. 2, Apr., 1964, págs. 91 - 96.
- Basak, S. and A. Shapiro. "Value-at-Risk-Based Risk Management: Optimal Policies and Asset Prices", in *Review of Financial Studies*. Summer 2000, Vol. 14, No. 2, págs. 371 - 405.
- Baxter, M. and A. Rennie. *Financial Cal-*

Fernand Libardo Rodríguez Barragán

Profesor/investigador del CIPE, Facultad de Finanzas Gobierno y Relaciones Internacionales. Miembro del observatorio de Economía y Operaciones Numéricas
E-mail: felroba@hotmail.com

"Los estados financieros son como el perfume de calidad; hay que olerlo pero no tragárselo"

Abraham Brilloff

- culus. Cambridge University Press. 1999.
- Benninga, Simon. *Financial Modeling*. 2ª edición. Cambridge, MA. The MIT Press. 2000.
- Bergés, Ángel y Ontiveros, Emilio. *Mercados de futuros e instrumentos financieros*. Madrid: Ediciones Pirámide, 1984.
- Bernstein, Peter L. *Against The Gods: The Remarkable Story of Risk*. New York. John Wiley and Sons. 1998.
- Bierwag, Gerald O. *Análisis de la duración. La gestión del riesgo de tipo de interés*. Alianza Economía y Finanzas.
- Black, F. and M. Scholes.
- “The Pricing of Options and Corporate Liabilities”, in *Journal of Financial Economics*, 1979.
- Borrell, Máximo y Roa, Alfonso. *Los mercados de futuros financieros*. Ariel Economía.
- Brealy, R. and S. Myers. *Fundamentos de financiación empresarial*, Madrid: McGraw-Hill, 1992.
- Brealy, R. and S. Myers. *Principles of Corporate Finance*, 7th Edition, Irwin, McGraw-Hill, 2003.
- Campbell, Y. J., A. W. Lo and C. MacKinley. *The Econometrics of Financial Markets*, Princeton University Press. 1997.
- Casanovas, Montserrat. *Opciones financieras*. Pirámide.
- Claverie,, María Olimpia. *Elementos principales del modelo descriptivo del comportamiento de los individuos ante situaciones de decisión bajo riesgo de Kahneman y Tversky*, Fascículo Código 155, Centro de Estudiantes de Ciencias Económicas, Universidad de Buenos Aires, págs. 87 y ss.
- Comas, Jordi. *Les opcions i futurs financers*. Tibidabo. Company, Inc., John Willey & Sons, Inc., 3 rd. Edition, 2000.
- Copeland, T., T. Koller and J. Murrin. *Valuation: Measuring and Managing the Value of Companies*, McKinsey &.
- Copeland, T. E. and J. F. Weston. *Financial Theory and Corporate Policy*, 3rd edition, Massachusetts: Addison Wesley, 1988.
- Copeland, Tom y Vladimir Antikarov. *Real Options: A Practitioner's Guide*. New York. Texere, 2001.
- Córdoba Bueno, Miguel. *Análisis financiero de los mercados monetarios y de valores*. Madrid: AC, 1996.
- Christian, G, and M. Machina. *Non-Expected Utility and Risk Management*, Boston: Kluwer Academic Publishers, 1995.
- Dalton, Steve. *Excel Add-in Development in C/C++: Applications in Finance* (The Wiley Finance Series).
- Dash, Jan W. *Quantitative Finance and Risk Management: A Physicist's Approach*.
- Díez de Castro, Luis. *Ingeniería financiera: la gestión en los mercados financieros internacionales*. Madrid. McGraw-Hill- Interamericana de

- España. 1991.
- Dimson, Elroy, Paul Marsk y Mike Staunton. *Triumph of the Optimists: 101 Years of Global Investment Returns*. Princeton, NJ. Princeton University Press. 2002.
- Dowd, K. "Financial Risk Management", en *Financial Analysts Journal*, July-Aug., 1999, págs. 65 - 71.
- Downes, John, Elliot Goodman y Jordan Elliot Goodman. *Dictionary of Finance and Investment Terms*. 5ª Edición. New York. Barron's Educational Services Inc. 1998.
- Eeckhoudt, L. and G. Christian. *Risk: Evaluation, Management and Sharing*, New York: Harvester Wheatsheaf, 1995.
- Elton, E. and M. Gruber. *Modern Portfolio Theory and Investment Analysis*, 5a. edition, New York: Wiley and sons, 1995.
- Ezquiaga, Ignacio. *El mercado español de deuda del Estado: estructura y formación de precios*. Barcelona: Ariel Economía, 1991.
- Fernández Blanco, Matilde y otros. *Opciones, activos, mercado y valoración*. Instituto OM y IEAF.
- Fernández, Pablo. *Opciones y valoración de instrumentos financieros*. Ediciones Deusto.
- FONDO MONETARIO INTERNACIONAL. *Financial Crises: Characteristics and Indicators of Vulnerability*, en World Economic Outlook, 1 mayo de 1998.
- Freixas, Xavier. *Futuros financieros*. Madrid: Alianza Editorial, 1990.
- Garber, P. y S. Weisbrod. *The economics of banking, liquidity and money*, Lexington, Mass., D.C. Heath, 1992.
- Greenbaum, S. y A. Thakor. *Contemporary financial intermediation*, Fort Worth: Dryden Press, 1995.
- Grossman, S. and J. Stiglitz. On the Impossibility of Informationally Efficient Markets, in *American Economic Review*, 1980, págs. 393 - 408.
- Helliwel, John F. y Mao, James C. T.; *Decisiones de inversión en condiciones de incertidumbre: teoría y práctica*, Tomo IV - B, págs. 849 y ss.
- Hertz, David B. *La incertidumbre y el riesgo en la evaluación de proyectos de inversión*, Tomo I - A, págs. 139 y ss.
- Hespos, Richard F. Y Strassman, Paul A. *Árboles probabilísticos de decisión*, Tomo I - A, págs. 139 y ss.
- Higgins, Robert C. *Análisis para la dirección financiera*. 7ª. ed., Madrid: Mc Graw Hill. 2004.
- Higham, Desmond. *An Introduction to Financial Option Valuation: Mathematics Stochastic and Computation*.
- Ho, Thomas S. Y., Sang Bin Lee y Sang-Bin Yi. *The Oxford Guide to Financial Modeling: Applications for Capital Markets, Corporate Finance, Risk Management and Financial Institutions*.
- Holton, Glyn A. *Value-at-Risk: Theory and Practice*.

- Huang, C. F. and D. Litzenberger. *Foundations for Financial Economics*. Englewood Cliffs: Prentice Hall, 1988.
- Hull, J. C. *Introducción a los mercados de futuros y opciones*, 4a. ed., Prentice Hall.
- Hull, J.C. *Options, Futures and other Derivatives*. 4th Edition. Englewood Cliffs: Prentice Hall, 2000.
- Ingersoll, J. E. *Theory of Financial Decision Making*. Totowa (N.J.): Rowan & Littlefield, 1987.
- Ketterer, Joan Antoni y Larraga, Pablo. "Suplemento del sistema financiero". *Papeles de Economía Española*, núm. 29.
- Kolb, R. *Understanding Futures Markets*. 3a. ed. Miami: Kolb Publishing Company, 1991.
- Kreps, D. *Game theory and economic modelling*, Oxford, Clarendon Press, 1990.
- Lamothe, Prosper y Prieto, Francisco. *Los activos de renta fija. Valoración y principios de gestión*. Bolsa de Madrid.
- Lamothe, Prosper. *Opciones financieros. Un enfoque fundamental*. Mc Graw Hill.
- Larraga, Pablo y otros. *Futuros sobre índices*. Ediciones Cinco Días.
- Leland, H. "Beyond Mean-Variance Risk and Performance in a Non-Symmetrical World", en *Financial Analysts Journal*, Jan-Feb. 1999, págs. 27-36.
- Luehrman, Timothy A. *Using APV: A Better Tool for Valuing Options*. En Harvard Business Review, mayo-junio 1997.
- Madura, Jeff. *Mercados e instituciones financieras*. 5^a. ed. México: Thomson Learning. 2001.
- Malliavin, Paul y Thalmaier, Anton. *Stochastic Calculus of Variations in Mathematical Finance*.
- Malliavin, Paul y Thalmaier, Anton. *Stochastic Calculus of Variations in Mathematical Finance*.
- Marín, J. y G. Rubio. *Economía financiera*. Barcelona: Antoni Bosch, 2001.
- Markowitz, Harry M. *Portfolio Selection: Efficient Diversification of Investments* (Cowles Foundation Monograph: No. 16).
- Markowitz, Harry M., Fabozzi Frank J., Kostovetsky, Leonard. *The Theory and Practice of Investment Management Workbook: Step-by-Step Exercises and Tests to Help You Master The Theory and Practice of Investment Management*. (Frank J. Fabozzi Series).
- Markowitz, Harry M., Todd G. Peter., Sharpe William F. *Mean-Variance Analysis in Portfolio Choice and Capital Markets*.
- Martín, José Luis y Ruiz, Ramón Jesús. *El inversor y los mercados financieros*. Ariel Economía.
- Martínez Abascal, Eduardo. *Futuros y opciones en la gestión de carteras*.
- Mas Colell, A., M. Whinston y J. Green. *Microeconomic theory*, Oxford: Oxford

- University Press, 1995.
- Mauleón, Ignacio. *Inversiones y riesgos financieros*. Espasa Calpe.
- Meneu, Vicente, Navaro, Eliseo y Barreira, María Teresa. *Análisis y gestión del riesgo de interés*. Ariel Economía.
- Merton, Robert C. *Continuous-Time Finance*. Blackwell. 1992.
- Merton, Robert C. "An analytic derivation of the efficient portfolio frontier". *Journal of Financial and Quantitative Analysis*. September 1972.
- Merton, Robert. "Capital Market Theory", in *Handbook of Monetary Economics*, Vol.1, Edited by B. Friedman & F. Hahn, North Holland Press, 1990.
- Myerson, R. *Game theory, analysis of conflicts*, Cambridge, Mass, Harvard University Press, 1991.
- Mykdashi, Z. *Nouvelles politiques bancaires et système financier international*. París. Económica, 1987.
- Natenberg, Sheldon. *Option volatility and pricing strategies*. Probus.
- Neftci, Salih. *An Introduction to the Mathematics of Financial Derivatives*. 2nd ed., San Diego, Academic Press. 2000.
- O'Hara, M. *Market Microstructure Theory*, Cambridge, Massachusetts: Blackwell Publishers, 1995.
- Ontiveros, Emilio y Bergés, Ángel. *Mercados de futuros en instrumentos financieros*. Pirámide.
- Ontiveros, Emilio y Valero, F. J. *Introducción al sistema financiero español*. Madrid. Civitas. 1994.
- Ontiveros, Emilio, Bergés, Ángel, Manzano, D. y Valero, F. J. *Mercados financieros internacionales*. Madrid: Espasa-Calpe, 1993.
- Ontiveros, Emilio. *Mercados financieros internacionales*. Madrid: Espasa-Calpe, 1991.
- Parejo Gámiz, J. A. *El sistema financiero en los países de la CE*. Madrid, Editorial AC, 1993.
- Pratt, J. W. *Risk Aversion in the Small and in the Large*. Econometrica 1964.
- Romero, Carlos. *Introducción a la financiación empresarial y al análisis bursátil*. Madrid. Alianza Editorial, 1987.
- Salanié, B. *The theory of contracts*, Cambridge, Mass.: MIT Press, 1991.
- Sánchez Fernández de Valderrama, J. L. *Curso de bolsa y mercados financieros*. Barcelona. Ariel. 1996.
- Sarsa López, Domingo: *Manual de derivados financieros para las PYMES*. Vicens Vives.
- Schwartz, E. and J. M. Hill and T. Schauweis. —*Financial Futures, Fundamentals, Strategies and Applications*. Irwin Homewood. 1986.
- Sengupta, Chandan. *Financial Modeling Using Excel and VBA* (Wiley Finance).
- Shimko, David (editor).—*Credit Risk: Models and Management*, Second Edition.

- Shreve, Steven E.—*Stochastic Calculus for Finance I*.
- Shreve, Steven E. *Stochastic Calculus for Finance II: Continuous-Time Models* (Springer Finance).
- Stampfli, Joseph y Víctor Goodman. *Matemáticas para las Finanzas. Modelado y cobertura*. Thompson Editores. México. 2002.
- Stigum, M. *The Money Market*. 3a. ed. Richard D Irwin, Inc, 1990.
- Thomas, G. y Morgan-Witts, M. *El día en que se hundió la bolsa*. Barcelona. Plaza y Janés, 1983.
- Valero, Francisco Javier. *Opciones e instrumentos financieros*. Ariel, Economía.
- Verchik, Ana; “*Derivados Financieros y de Productos: Una visión más completa de los negocios*”, Ediciones Macchi. Buenos Aires, Argentina, 2000.
- White, D.J. *Markov Decision Processes*.
- <http://www.bde.es>
<http://www.bde.es/estadis/estadis.htm>
<http://www.bis.org>
<http://www.bog.frb.fed.us>
<http://www.bolsabilbao.es/bolsa/es/html/home-es.html>
<http://www.bolsamadrid.es/esp/portada.htm>
<http://www.bolsasymercados.es>
<http://www.bolsavalencia.es/homeinicial.asp>
<http://www.borsabcn.es>
<http://www.cftc.gov>
<http://www.cmvm.pt>
<http://www.fsa.gov.uk>
<http://www.cnmv.es>
<http://www.cob.fr>
<http://www.cob.fr/eng/index.html>
<http://www.consob.it>
<http://www.ecb.int>
<http://www.eurexchange.com/index.html>
<http://www.euronext.com/home/0,3766,1732,00.html>
<http://www.euronext.pt/bvlp/contactos.jsp>
<http://www.europesefesco.org>
<http://www.feas.org>
<http://www.federalreserve.gov>
<http://www.fiafii.org>
<http://www.fibv.com>
<http://www.futuresview.com>
<http://www.iberclear.com>
<http://www.iberclear.es/Iberclear/home/home.htm>
<http://www.iosco.org>
<http://www.iosco.org>
<http://www.ise.ie/>
- PÁGINAS WEB**
- <http://finmath.com/>
<http://fisher.osu.edu/fin/journal/jofsites.htm>
<http://www.aciforex.com/>
<http://www.aex.nl/aex.asp?taal=en>
<http://www.aiaf.es>
<http://www.aiaf.es/aiaf/index.home>
<http://www.almaz.com/nobel/economics/1990a.html>
<http://www.amex.com/>
<http://www.bankofengland.co.uk>
<http://www.bawe.de>

<http://www.liffe.com/>
<http://www.lme.co.uk/>
<http://www.meff.com/index2.html>
<http://www.meff.com/instituto/futuros/sindex.htm>
<http://www.meffclear.com/index2.html>
<http://www.mineco.es/tesoro>
<http://www.oecd.org>
<http://www.publicdebt.treas.gov>
<http://www.sbolsas.com>
<http://www.sbolsas.com/index01.htm>
<http://www.sclv.es>
<http://www.sec.gov>
<http://www.senaf.net/index2.html>
<http://www.sib.co.uk>
<http://www.ste.nl>
<http://www1.fee.uva.nl/fm/material/advcorpfin/advcorpfin.htm>
www.abiworld.org
www.annualreportservice.com
www.bancoval.es
www.berkshirehathaway.com
www.bigcharts.marketwatch.com
www.biz.yahoo.com/i/
www.bloomberg.com
www.bog.frb.fed.us
www.bond-exchange.com
www.bondsonline.com/corpinde.html
www.capital.com
www.clev.frb.org
www.crystalball.com
www.dfaunds.com/The_Firm/About_Dimensional/Philosophy/History/Chicago/miller.html
www.duke.edu/~charvey/Classes/wpg/glossary.htm
www.e-analytics.com
www.edgarscan.pwglobal.com
www.exinfm.com/free_spreadsheets.html
www.extension.iastate.edu/Pages/Excel/homepage.html
www.finance.yahoo.com
www.firstmiami.com
www.hadm.sph.sc.edu/COURSES/ECON/irr/irr.html
www.intrepid.com/~robertl
www.intrepid.com/~robertl/option-pricer.html
www.investors.com
www.iporesources.org/
www.margrabe.com
www.meff.com/docs/guia2.pdf
www.mergerstat.com
www.moneycentral.msn.com/investor/invsb/results/compare.asp
www.nasdaq.com
www.nationalpress.org/html/programs/financstatement.htm
www.nvca.org
www.ny.frb.org
www.nyse.com
www.optionstrategist.com/free/analysis/data/index.html
www.pages.stern.nyu.edu/~adamodar/New_Home_Page/
www.publicdebt.treas.gov/serviet/OFNtebnd
www.real-options.com
www.research.stlouisfed.org/fred/
www.riskgrades.com
www.stls.frb.org/publications/mt
www.stocktrader.com
www.valuepro.net
www.vanguard.com

