

Curso Académico: (2020 / 2021)

Fecha de revisión: 04-07-2020

Departamento asignado a la asignatura: Departamento de Economía de la Empresa

Coordinador/a: BALBAS DE LA CORTE, ALEJANDRO

Tipo: Obligatoria Créditos ECTS : 6.0

Curso : 1 Cuatrimestre : 2

REQUISITOS (ASIGNATURAS O MATERIAS CUYO CONOCIMIENTO SE PRESUPONE)

No hay especiales requisitos para estudiantes con grados en Economía, Empresa, Ciencias o Ingeniería.

OBJETIVOS

- 1) Mercado de capitales, equilibrio y sus aplicaciones en valoración, cobertura y eficiencia de mercados.
- 2) Valoración y cobertura de productos derivados.
- 3) Mercados de renta fija, tipos de interés y primas de riesgo.

DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS: PROGRAMA

1. Futuros y contratos a plazo
2. Introducción a los mercados de opciones
3. Modelo de Black-Scholes
4. Estructura temporal de los tipos de interés
5. Riesgo de interés y cobertura
6. Mercados eficientes y teoría de carteras
7. Modelos APT
8. Modelo CAPM
9. Otros modelos factoriales

ACTIVIDADES FORMATIVAS, METODOLOGÍA A UTILIZAR Y RÉGIMEN DE TUTORÍAS

Metodología;

- 1) Clases teóricas
- 2) Lecciones prácticas
- 3) Ejercicios
- 4) Lectura y debate sobre artículos académicos

Además, los estudiantes y el profesor podrán debatir durante tres horas por semana.

SISTEMA DE EVALUACIÓN

- 1) Exame final, 60%
- 2) Ejercicios prácticos, 20%
- 3) Trabajo sobre un tema específico, 20%

Peso porcentual del Examen Final: 60

Peso porcentual del resto de la evaluación: 40

BIBLIOGRAFÍA BÁSICA

- Brealey, R., S. C. Myers and F. Allen Principles of Corporate Finance, McGraw Hill, .
- Fabozzi, F. Bond Markets, Analysis and Strategies, Prentice-Hall International, Inc, .
- Hull, J. Options, Futures and other Derivatives, Prentice-Hall International, Inc, .

