

Curso Académico: ( 2021 / 2022 )

Fecha de revisión: 28-06-2021

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

Coordinador/a: BALBAS DE LA CORTE, ALEJANDRO

Tipo: Optativa 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.

Enlace al documento

**DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS: PROGRAMA**

- Análisis Financiero
- Mercados Financieros
- Herramientas para el Análisis Financiero
- Contratos a futuros y por diferencias
- Introducción a los mercados de opciones
- El modelo de Black-Scholes
- Estructura temporal de las tasas de interés
- Estimación del TSIR
- Seguros frente al riesgo de la tasa de interés
- Eficiencia de mercados y elección de cartera
- Modelos APT
- Modelo de valoración de activos de capital (CAPM)

**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) Examen 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.

