

Curso Académico: (2023 / 2024)

Fecha de revisión: 24-04-2023

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.

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.

