

**FITXA IDENTIFICATIVA****Dades de l'Assignatura**

Codi	42210
Nom	Derivats (ampliació)
Cicle	Màster
Crèdits ECTS	6.0
Curs acadèmic	2020 - 2021

Titulació/titulacions

Titulació	Centre	Curs	Període
2081 - M.U. en Banca i Finances Quantitatives 09-V.1	Facultat d'Economia	2	Anual

Matèries

Titulació	Matèria	Caràcter
2081 - M.U. en Banca i Finances Quantitatives 09-V.1	2 - Matèries optatives	Optativa

Coordinació

Nom	Departament
TORRO I ENGUIX, HIPOLIT	113 - Economia Financera i Actuarial

RESUM

Introducció a les diferents tècniques de valoració i cobertura d'opcions exòtiques, derivats sobre productes energètics i sobre actius de renda fixa. Al final del curs, l'estudiant ha de conèixer i dominar les diferents tècniques de valoració (analítica/numèrica) que es poden implementar amb aquests actius derivats.

CONEIXEMENTS PREVIS**Relació amb altres assignatures de la mateixa titulació**

No heu especificat les restriccions de matrícula amb altres assignatures del pla d'estudis.



Altres tipus de requisits

Relació amb altres assignatures:

Aquest curs és la continuació natural de l'assignatura "derivats" impartida en el primer any del màster. Així, es desenvolupen més detalladament molts dels diferents conceptes i models introduïts en aquesta assignatura.

Addicionalment, aquesta assignatura complementa part de la matèria inclosa en l'assignatura "models de renda fixa", també impartida en el primer curs d'aquest màster.

COMPETÈNCIES

RESULTATS DE L'APRENTATGE

Aquest curs té com a objectiu desenvolupar les habilitats analítiques i quantitatives en els diferents models de valoració de derivats

DESCRIPCIÓ DE CONTINGUTS

1. Tema 1. Valoració analítica d'opcions exòtiques (path-dependent).

2. Tema 2. Derivats sobre productes energètics.

3. Tema 3. Derivats de tipus d'interès

4. Tema 4. Models de volatilitat estocàstica.

5. Tema 5. Valoració d'opcions mitjançant simulació Monte Carlo

6. Tema 6. Opcions reals.

**VOLUM DE TREBALL**

ACTIVITAT	Hores	% Presencial
Classes de teoria	60,00	100
TOTAL	60,00	

METODOLOGIA DOCENT

Docència presencial (classe magistral i pràctiques d'aula) i no presencial (pràctiques d'ordinador).

AVALUACIÓ

Avaluació contínua (exercicis, presentacions) i examen escrit final.

REFERÈNCIES**Bàsiques**

- Hull, J. (2011) Options, Futures and other Derivatives Prentice Hall, 8th edition.
- Paul Wilmott on Quantitative Finance Vol 1-3, 2nd Ed. Paul Wilmott

ADDENDA COVID-19

Aquesta addenda només s'activarà si la situació sanitària ho requereix i previ acord del Consell de Govern

En caso de tener que suspenderse la actividad presencial, el programa se reorganizará para poder continuar online con el desarrollo del Máster, manteniendo la calidad y el rigor tanto de las clases como de los métodos de evaluación. La Comisión Académica valorará la conveniencia de modificar la forma de evaluación de las asignaturas y cualquier posible cambio será anunciado al alumnado a la mayor brevedad posible.