

**FICHA IDENTIFICATIVA****Datos de la Asignatura**

Código	42210
Nombre	Derivados (ampliación)
Ciclo	Máster
Créditos ECTS	6.0
Curso académico	2021 - 2022

Titulación(es)

Titulación	Centro	Curso	Periodo
2081 - M.U. en Banca y Finanzas Cuantitativas 09-V.1	Facultad de Economía	2	Anual

Materias

Titulación	Materia	Caracter
2081 - M.U. en Banca y Finanzas Cuantitativas 09-V.1	2 - Materias optativas	Optativa

Coordinación

Nombre	Departamento
TORRO I ENGUIX, HIPOLIT	113 - Economía Financiera y Actuarial

RESUMEN

Introducción a las diferentes técnicas de valoración y cobertura de opciones exóticas, derivados sobre productos energéticos y sobre activos de renta fija. Al final del curso, el estudiante deberá conocer y dominar las diferentes técnicas de valoración (analítica/numérica) que se pueden implementar con estos activos derivados

CONOCIMIENTOS PREVIOS**Relación con otras asignaturas de la misma titulación**

No se han especificado restricciones de matrícula con otras asignaturas del plan de estudios.



Otros tipos de requisitos

Relación con otras asignaturas:

Este curso es la continuación natural de la asignatura derivados impartida en el primer año del máster. Así, se desarrollan mas detalladamente muchos de los diferentes conceptos y modelos introducidos en dicha asignatura.

Adicionalmente, esta asignatura complementa parte de la materia incluida en la asignatura modelos de renta fija, también impartida en el primer curso de este master.

COMPETENCIAS

RESULTADOS DE APRENDIZAJE

Este curso tiene como objetivo desarrollar las habilidades analíticas y cuantitativas en los diferentes modelos de valoración de derivados

DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS

1. Tema 1. Valoración analítica de opciones exóticas (path-dependent).

2. Tema 2. Derivados sobre productos energéticos.

3. Tema 3. Derivados de tipos de interés.

4. Tema 4. Modelos de volatilidad estocástica.

5. Tema 5. Valoración de opciones mediante simulación Monte Carlo

6. Tema 6. Opciones reales.

**VOLUMEN DE TRABAJO**

ACTIVIDAD	Horas	% Presencial
Clases de teoría	60,00	100
TOTAL	60,00	

METODOLOGÍA DOCENTE

Docencia presencial (clase magistral y prácticas de aula) y no presencial (prácticas de ordenador).

EVALUACIÓN

Evaluación continua (ejercicios, presentaciones) y superar un examen escrito final que puntuará al menos el 70% de la nota final.

REFERENCIAS**Básicas**

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

ADENDA COVID-19

Esta adenda solo se activará si la situación sanitaria lo requiere y previo acuerdo del Consejo de Gobierno

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.