

**COURSE DATA****Data Subject**

Code	42210
Name	Derivatives (extension)
Cycle	Master's degree
ECTS Credits	6.0
Academic year	2021 - 2022

Study (s)

Degree	Center	Acad. year	Period
2081 - M.U. Banca y Finanzas Cuantitativas (2007)	Faculty of Economics	2	Annual

Subject-matter

Degree	Subject-matter	Character
2081 - M.U. Banca y Finanzas Cuantitativas (2007)	2 - Optional subjects	Optional

Coordination

Name	Department
TORRO I ENGUIX, HIPOLIT	113 - Financial and Actuarial Economics

SUMMARY**English version is not available**

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

PREVIOUS KNOWLEDGE

**Relationship to other subjects of the same degree**

There are no specified enrollment restrictions with other subjects of the curriculum.

Other requirements

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.

OUTCOMES**LEARNING OUTCOMES**

English version is not available

WORKLOAD

ACTIVITY	Hours	% To be attended
Theory classes	60,00	100
TOTAL	60,00	

TEACHING METHODOLOGY

English version is not available

EVALUATION

English version is not available

REFERENCES



Basic

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

ADDENDUM COVID-19

This addendum will only be activated if the health situation requires so and with the prior agreement of the Governing Council

English version is not available

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.