

61435 - Instrumentos financieros avanzados

Información del Plan Docente

Año académico: 2023/24

Asignatura: 61435 - Instrumentos financieros avanzados

Centro académico: 109 - Facultad de Economía y Empresa

Titulación: 526 - Máster Universitario en Contabilidad y Finanzas

Créditos: 4.0

Curso: 1

Periodo de impartición: Segundo semestre

Clase de asignatura: Optativa

Materia:

1. Información básica de la asignatura

La asignatura y sus resultados previstos responden a los siguientes planteamientos y objetivos:

- 1) Familiarizar al alumno con los mercados de derivados, los activos negociados y su operativa.
- 2) Transmitir las principales técnicas de valoración de las opciones exóticas.
- 3) Análisis de los derivados de crédito
- 4) Presentar las metodologías aplicables en la gestión de carteras y productos estructurados.

Estos planteamientos y objetivos están alineados con los Objetivos de Desarrollo Sostenible (ODS) de la Agenda 2030 de Naciones Unidas (<https://www.un.org/sustainabledevelopment/es/>) en concreto, las actividades de aprendizaje previstas en esta asignatura contribuirán al logro de las metas 4.3, 4.4 y 4.7 del Objetivo 4, de la meta 5.5 del Objetivo 5 y de la meta 8.5 del Objetivo 8.

2. Resultados de aprendizaje

El estudiante, para superar esta asignatura, deberá demostrar los siguientes resultados:

- 1) Disponer de una visión de conjunto de los mercados financieros modernos.
- 2) Diseñar estructuras complejas de especulación, arbitraje y cobertura.
- 3) Conocer, de modo exhaustivo, los productos financieros denominados OTC que se negocian en los mercados financieros.
- 4) Conocer y utilizar instrumentos derivados exóticos y su valoración.

3. Programa de la asignatura

PARTE I: DERIVADOS PLAIN-VANILLA

Tema 1: Futuros y opciones regulados

Tema 2: Estrategias combinadas

Tema 3: Valoración de opciones

PARTE II: OPCIONES EXÓTICAS

Tema 4: Tipología de opciones exóticas

Tema 5: Productos estructurados

PARTE III: OTROS DERIVADOS OTC

Tema 6: Contracts For Differences (CFDs)

Tema 7: Aplicaciones de instrumentos derivados

4. Actividades académicas

Clases magistrales participativas

Sesiones con el profesor en las que se explicará el temario de la asignatura: 20 horas

Clases prácticas

Sesiones de resolución de problemas y casos prácticos planteados por el profesor y presentación de trabajos: 20 horas

Estudio de la materia y trabajo personal: 40 horas

5. Sistema de evaluación

El estudiante deberá demostrar que ha alcanzado los resultados de aprendizaje previstos mediante las siguientes

actividades de evaluación:

a) Evaluación continua

Se propone la realización de tres pruebas escritas con la siguiente distribución del peso:

- Primera prueba escrita: 20%
- Segunda prueba escrita: 30%
- Tercera prueba escrita: 30%
- Casos Prácticos: 20%

Los casos prácticos consistirán en la realización obligatoria de trabajos que se desarrollarán en el aula de informática en la que los alumnos tendrán que resolver casos prácticos de derivados financieros.

b) Evaluación global

El estudiante que no opte por la evaluación continua o que no supere la asignatura por este procedimiento o que quiera mejorar su calificación, tendrá derecho a presentarse a la prueba global que consistirá en una prueba escrita, en la que tenga que desarrollar tanto aspectos teóricos como prácticos de la asignatura.

En primera convocatoria el alumno puede elegir entre evaluación continua y global. En segunda convocatoria, la evaluación se reduce a la evaluación global anteriormente indicada.