

Guía docente

Identificación de la asignatura

Asignatura / Grupo	11647 - Derivados Financieros / 1
Titulación	Máster Universitario en Análisis de Datos Masivos en Economía y Empresa
Créditos	3
Período de impartición	Segundo semestre
Idioma de impartición	Castellano

Profesores

Horario de atención a los alumnos

Profesor/a	Hora de inicio	Hora de fin	Día	Fecha inicial	Fecha final	Despacho / Edificio
María Magdalena Massot Perelló m.massot@uib.es	11:00	12:00	Viernes	01/09/2019	31/07/2020	DB-115 / Ed. Jovellanos

Contextualización

Esta asignatura se imparte en el Master Análisis de Datos Masivos en Economía y Empresa durante el segundo semestre. Es optativa y está ubicada en el módulo de Técnicas y Aplicaciones a la Gestión Económica y Empresarial.

Su objetivo es proporcionar a los alumnos un conocimiento básico de los denominados activos derivados. Atendiendo a este objetivo, las cuestiones específicamente contempladas incluyen el estudio de las características de los diferentes derivados que negocian en los mercados financieros, explicar cómo funcionan y, por tanto, cómo pueden ser utilizados para operaciones especulativas y de cobertura, y atender a su valoración. La adquisición de dichos conocimientos resulta imprescindible para poder hacer un uso adecuado del enorme volumen de datos generados por la negociación de dichos activos.

Requisitos

Esta asignatura está diseñada conjuntamente con la asignatura 11650 Finanzas Cuantitativas.

Así pues, se recomienda cursar 11647 sólo si el objetivo es cursar la 11650.

Competencias

Específicas

- * CE10 Conocer los ámbitos de aplicación del paradigma "Big Data" y desarrollar la capacidad para extender el análisis de datos a actividades estratégicas en economía, empresa y turismo.



Guía docente

* CESP5 Capacidad para utilizar datos de alta frecuencia en el análisis de mercados financieros.

Genéricas

* CG6 Capacidad para aplicar los principios de la ciencia de datos a la economía, la empresa y el turismo.

Básicas

* Se pueden consultar las competencias básicas que el estudiante tiene que haber adquirido al finalizar el máster en la siguiente dirección: http://estudis.uib.cat/es/master/comp_basiques/

Contenidos

Contenidos temáticos

1. Futuros y opciones: introducción
2. Futuros y opciones: estrategias
3. Formación de precios forward
4. Valoración de opciones
5. Opciones exóticas y productos estructurados
6. Derivados sobre tipos de interés

Metodología docente

Actividades de trabajo presencial (0,72 créditos, 18 horas)

Modalidad	Nombre	Tip. agr.	Descripción	Horas
Clases teóricas		Grupo grande (G)	Explicar el contenido teórico de la asignatura	8
Clases prácticas		Grupo grande (G)	Aplicar los conocimientos teóricos adquiridos para reforzar su aprendizaje	8
Evaluación	Examen final	Grupo grande (G)	Comprobar que el alumno ha adquirido los conocimientos impartidos en la asignatura en su conjunto	2

Al inicio del semestre estará a disposición de los estudiantes el cronograma de la asignatura a través de la plataforma UIBdigital. Este cronograma incluirá al menos las fechas en las que se realizarán las pruebas de evaluación continua y las fechas de entrega de los trabajos. Asimismo, el profesor o la profesora informará a los estudiantes si el plan de trabajo de la asignatura se realizará a través del cronograma o mediante otra vía, incluida la plataforma Aula Digital.

Actividades de trabajo no presencial (2,28 créditos, 57 horas)

Guía docente

Modalidad	Nombre	Descripción	Horas
Estudio y trabajo autónomo individual	Prueba 2	Comprobar que el alumno ha adquirido el contenido del tema 2	2
Estudio y trabajo autónomo individual	Prueba 3	Comprobar que el alumno ha adquirido el contenido del tema 3	2
Estudio y trabajo autónomo individual	Prueba 4	Comprobar que el alumno ha adquirido el contenido del tema 4	2
Estudio y trabajo autónomo individual	Prueba 5	Comprobar que el alumno ha adquirido el contenido del tema 5	2
Estudio y trabajo autónomo individual	Prueba 1	Comprobar que el alumno ha adquirido el contenido del tema 1	2
Estudio y trabajo autónomo individual o en grupo		Reforzar los conocimientos adquiridos durante cada una de las sesiones presenciales	47

Riesgos específicos y medidas de protección

Las actividades de aprendizaje de esta asignatura no conllevan riesgos específicos para la seguridad y salud de los alumnos y, por tanto, no es necesario adoptar medidas de protección especiales.

Evaluación del aprendizaje del estudiante

Fraude en elementos de evaluación

De acuerdo con el artículo 33 del Reglamento Académico, "con independencia del procedimiento disciplinario que se pueda seguir contra el estudiante infractor, la realización demostrablemente fraudulenta de alguno de los elementos de evaluación incluidos en guías docentes de las asignaturas comportará, a criterio del profesor, una minusvaloración en su calificación que puede suponer la calificación de «suspense 0» en la evaluación anual de la asignatura".

Examen final

Modalidad	Evaluación
Técnica	Pruebas de respuesta breve (no recuperable)
Descripción	Comprobar que el alumno ha adquirido los conocimientos impartidos en la asignatura en su conjunto
Criterios de evaluación	
Porcentaje de la calificación final: 50% con calificación mínima 4	

Guía docente

Prueba 2

Modalidad	Estudio y trabajo autónomo individual
Técnica	Pruebas de respuesta breve (no recuperable)
Descripción	Comprobar que el alumno ha adquirido el contenido del tema 2
Criterios de evaluación	
Porcentaje de la calificación final:	10%

Prueba 3

Modalidad	Estudio y trabajo autónomo individual
Técnica	Pruebas de respuesta breve (no recuperable)
Descripción	Comprobar que el alumno ha adquirido el contenido del tema 3
Criterios de evaluación	
Porcentaje de la calificación final:	10%

Prueba 4

Modalidad	Estudio y trabajo autónomo individual
Técnica	Pruebas de respuesta breve (no recuperable)
Descripción	Comprobar que el alumno ha adquirido el contenido del tema 4
Criterios de evaluación	
Porcentaje de la calificación final:	10%

Prueba 5

Modalidad	Estudio y trabajo autónomo individual
Técnica	Pruebas de respuesta breve (no recuperable)
Descripción	Comprobar que el alumno ha adquirido el contenido del tema 5
Criterios de evaluación	
Porcentaje de la calificación final:	10%

Prueba 1

Modalidad	Estudio y trabajo autónomo individual
Técnica	Pruebas de respuesta breve (no recuperable)
Descripción	Comprobar que el alumno ha adquirido el contenido del tema 1
Criterios de evaluación	
Porcentaje de la calificación final:	10%

Recursos, bibliografía y documentación complementaria

Bibliografía básica

Hull, J.C, Introducción a los Mercados de Futuros y Opciones, Prentice Hall, 2014.





Guía docente

Bibliografía complementaria

Grinblatt, M. y S. Titman, Mercados Financieros y Estrategia Empresarial, McGrawHill, 2010

Otros recursos

<http://bolsasymercados.es>
<http://en.boerse-frankfurt.de>
<http://www.cmegroup.com>

