



Máster Universitario en Economía

Universidad Complutense de Madrid

Asignatura: Economía y mercados de capitales II (605170)

Información de la asignatura

Módulo 2. Economía Aplicada. Materia 2.3. Economía Monetaria y Financiera

Carácter: OBLIGATORIO en itinerario *Economía Monetaria y Financiera*

Créditos ECTS: 4

Presenciales: 2

No presenciales: 2

Trimestre: SEGUNDO

Horas semanales presenciales: 3 horas de clase + 1 hora de seminario (clase práctica)

Profesores

Miguel A. Arranz Cuesta

Correo electrónico: maarranz@ucm.es

Departamento de Economía Aplicada III

Facultad CC. Económicas y Empresariales

Breve Sinopsis de la Asignatura

Riqueza, rentabilidad y riesgo. Valoración de activos bajo certidumbre e incertidumbre.

Futuros financieros. Opciones financieras

Conocimientos Previos Recomendados

Matemáticas, Estadística, Microeconomía, Macroeconomía

Objetivos Formativos

Estudio, desde una perspectiva primordialmente analítica, del papel de los activos financieros en la asignación de los recursos de una economía moderna

Competencias

Generales:

CG1: Dominio de los fundamentos de la economía y de al menos alguna de las áreas de la economía aplicada, así como de la metodología académica/profesional de dichas áreas.

CG2: Capacidad de identificar las fuentes relevantes de información económica (bases de datos, libros, artículos, etc.), de manejar adecuadamente esa información y de comprender y analizar críticamente dichas fuentes.

CG3: Capacidad de realizar un análisis crítico, evaluación y síntesis de ideas nuevas y complejas en economía a nivel avanzado.

CG4: Capacidad de resolver de forma autónoma tareas de investigación en economía.

CG5: Capacidad de redacción de informes profesionales y trabajos académicos en el ámbito de la economía.

CG6: Capacidad de desempeñar de forma competente puestos académicos y/o profesionales relacionados con la ciencia económica.

CG7: Capacidad de fomentar, en contextos académicos y profesionales, el progreso económico y social dentro de una sociedad basada en el conocimiento.

CG8: Capacidad de recibir y transmitir información en otros idiomas, principalmente inglés.

CG9: Capacidad de manejar adecuadamente las tecnologías de la información y las aplicaciones informáticas necesarias para el análisis económico.

Específicas:

CE4: Entender el funcionamiento básico de una economía moderna, centrándose en el análisis micro y macroeconómico y en el uso de las herramientas estadísticas y econométricas de uso habitual en la investigación aplicada.

CE5: Dominar la búsqueda y manejo de fuentes cuantitativas y cualitativas, primarias y secundarias, relevantes para el estudio de la economía. Identificar la información relevante y saber criticar, evaluar y tratar el contenido de las fuentes.

CE9: Comprender los fundamentos teóricos de las decisiones financieras y de la política monetaria y financiera y sus implicaciones para la asignación de los recursos de una economía.

CE10: Capacidad analítica para abordar el análisis del entorno macroeconómico y su interrelación con los aspectos monetarios y financieros de una economía.

Contenidos temáticos, planificación docente y bibliografía por temas

TEMA 1: Riqueza, rentabilidad y riesgo

Duración del Tema en clases:

5

Actividades dentro del Aula:

Clases teóricas magistrales, Clases teóricas dialogadas (donde el alumno ha preparado previamente la clase y participa activamente), Resolución de ejercicios

Actividades fuera del Aula: Preparación de materiales previamente a las clases, Resolución de ejercicios, Redacción de casos o trabajos, Búsqueda de información, Estudio de los conceptos básicos

Tiempo fuera del aula: 10

Bibliografía del Tema:

Barro, R. J.; Grilli, V. y Febrero, R. (1997), Macroeconomía. Teoría y Política, McGraw-Hill, Madrid.

Fama, E.F. (1976), Foundations of Finance, Basic Books, New York.

Cochrane, J. H. (2005), Asset Pricing (Revised), Princeton University Press.

TEMA 2: Valoración de activos bajo certidumbre e incertidumbre

Duración del Tema en clases: 5

Actividades dentro del Aula: Clases teóricas magistrales, Clases teóricas dialogadas (donde el alumno ha preparado previamente la clase y participa activamente), Resolución de ejercicios, Presentaciones de los alumnos

Actividades fuera del Aula: Preparación de materiales previamente a las clases, Resolución de ejercicios, Redacción de casos o trabajos, Búsqueda de información, Estudio de los conceptos básicos

Tiempo fuera del aula: 10

Bibliografía del Tema:

Barro, R. J.; Grilli, V. y Febrero, R. (1997), Macroeconomía. Teoría y Política, McGraw-Hill, Madrid.

Fama, E.F. (1976), Foundations of Finance, Basic Books, New York.

Cochrane, J. H. (2005), Asset Pricing (Revised), Princeton University Press.

TEMA 3: Futuros financieros

Duración del Tema en clases: 3

Actividades dentro del Aula: Clases teóricas magistrales, Clases teóricas dialogadas (donde el alumno ha preparado previamente la clase y participa activamente), Resolución de ejercicios, Presentaciones de los alumnos

Actividades fuera del Aula: Preparación de materiales previamente a las clases, Resolución de ejercicios, Búsqueda de información, Estudio de los conceptos básicos

Tiempo fuera del aula: 6

Bibliografía del Tema:

Hull, J. (2009), Options, Futures, and Other Derivatives, Prentice Hall, New Jersey.

Kolb, R.W. y Overdahl, J.A. (eds.) (2010), Financial Derivatives: Pricing and Risk Management, John Wiley & Sons, Hoboken, New Jersey.

Neftci, S. N. (2000), An Introduction to the Mathematics of Financial Derivatives, Academic Press, London.

TEMA 4: Opciones financieras

Duración del Tema en clases: 7

Actividades dentro del Aula: Clases teóricas magistrales, Clases teóricas dialogadas (donde el alumno ha preparado previamente la clase y participa activamente), Resolución de ejercicios, Presentaciones de los alumnos

Actividades fuera del Aula: Preparación de materiales previamente a las clases, Resolución de ejercicios, Resolución de prácticas (informáticas o de ejercicios de cierta dificultad), Redacción de casos o trabajos, Búsqueda de información, Estudio de los conceptos básicos

Tiempo fuera del aula: 14

Bibliografía del Tema:

Hull, J. (2009), Options, Futures, and Other Derivatives, Prentice Hall, New Jersey.

Kolb, R.W. y Overdahl, J.A. (eds.) (2010), Financial Derivatives: Pricing and Risk Management, John Wiley & Sons, Hoboken, New Jersey.

Neftci, S. N. (2000), An Introduction to the Mathematics of Financial Derivatives, Academic Press, London.

Evaluación

<i>Participación activa en clase:</i>	15
<i>Resolución de ejercicios y problemas:</i>	20
<i>Realización y presentación de trabajos:</i>	15
<i>Pruebas escritas y orales:</i>	50

Herramientas que se utilizan en esta asignatura

Campus Virtual

Información complementaria