

Estudio Propio: **MÁSTER EN FINANZAS**

Código Plan de Estudios: **EM99**

Año Académico: **2018-2019**

ESTRUCTURA GENERAL DEL PLAN DE ESTUDIOS:

| CURSO | Obligatorios | | Optativos | | Prácticas Externas | Memoria/ Proyecto | Créditos |
|-------------------------|--------------|----------------|-----------|----------------|--------------------|-------------------|----------|
| | Créditos | Nº Asignaturas | Créditos | Nº Asignaturas | Créditos | Créditos | |
| 1º | 45 | 11 | 9 | 3 | | 6 | 60 |
| 2º | | | | | | | |
| 3º | | | | | | | |
| ECTS TOTALES | 45 | 11 | 9 | 3 | | 6 | 60 |

PROGRAMA TEMÁTICO:

ASIGNATURAS OBLIGATORIAS

| Código Asignatura | Curso | Denominación | Carácter OB/OP | Créditos |
|-------------------|-------|--|----------------|----------|
| 704849 | 1 | MERCADOS FINANCIEROS | OB | 3 |
| 704850 | 1 | PRODUCTOS FINANCIEROS | OB | 6 |
| 704851 | 1 | ECONOMÍA INTERNACIONAL | OB | 3 |
| 704852 | 1 | ESTADÍSTICA Y ECONOMETRÍA | OB | 3 |
| 704853 | 1 | CONTABILIDAD FINANCIERA | OB | 3 |
| 704854 | 1 | RIESGOS FINANCIEROS | OB | 6 |
| 704855 | 1 | MÉTODOS COMPUTACIONALES | OB | 6 |
| 704856 | 1 | FINANZAS CORPORATIVAS | OB | 6 |
| 704857 | 1 | TRANSFORMACIÓN DIGITAL EN BANCA Y MERCADOS FINANCIEROS | OB | 3 |
| 704858 | 1 | GESTIÓN DE CARTERAS DE INVERSIÓN | OB | 3 |
| 704859 | 1 | SEMINARIOS | OB | 3 |

ASIGNATURAS OPTATIVAS (Se deberán elegir 3 asignaturas)

| Código Asignatura | Curso | Denominación | Carácter OB/OP | Créditos |
|-------------------|-------|-----------------------------------|----------------|----------|
| 704860 | 1 | REGULACIÓN FINANCIERA | OP | 3 |
| 704861 | 1 | VALORACIÓN DE EMPRESAS Y FUSIONES | OP | 3 |
| 704862 | 1 | INSTRUMENTOS DE FINANCIACIÓN | OP | 3 |
| 704863 | 1 | AUDITORÍA | OP | 3 |
| 704864 | 1 | PROCESOS ESTOCÁSTICOS | OP | 3 |

| | | | | |
|------------------------------|--------------|-----------------------|---------------------------|-----------------|
| 704865 | 1 | TRADING ALGORÍTMICO | OP | 3 |
| 704866 | 1 | BANCA DE INVERSIÓN | OP | 3 |
| 704867 | 1 | GESTIÓN PATRIMONIAL | OP | 3 |
| MEMORIA /PROYECTO | | | | |
| Código Asignatura | Curso | Denominación | Carácter OB/OP | Créditos |
| 704868 | 1 | TRABAJO FIN DE MÁSTER | OB | 6 |

Carácter: OB - Obligatoria; OP – Optativa

GUÍA DOCENTE

| | | |
|---------------------------------|-----------------------------|----------------|
| Año académico | 2018-19 | |
| Estudio | Máster en Finanzas (EM99) | |
| Nombre de la asignatura | MERCADOS FINANCIEROS | |
| Carácter (Obligatoria/Optativa) | Obligatoria | |
| Créditos (1 ECTS=25 horas) | 3 | |
| Modalidad (elegir una opción) | X | Presencial |
| | | Semipresencial |
| | | On-line |
| Profesor responsable | José Ignacio Olmeda Martos | |
| Idioma en el que se imparte | Español | |

DISTRIBUCIÓN DE CRÉDITOS (especificar en horas)

| | |
|--|----|
| Número de horas presenciales/on-line asistencia profesor | 21 |
| Número de horas de trabajo personal del estudiante | 54 |
| Total horas | 75 |

CONTENIDOS (Temario)

- Mercados de Renta Fija
- Mercados de Renta Variable
- Mercados de Derivados

EVALUACIÓN

El programa evalúa los aprendizajes mediante Pruebas de Evaluación Continua (PEC) de carácter teórico-práctico. Estas pruebas se programan en cada asignatura e incluyen los criterios de evaluación para los mismos.

BIBLIOGRAFÍA

Referencia Básica:

- Zvi Bodie and Alex Kane and Alan Marcus (214): *Investments*, McGraw Hill.

GUÍA DOCENTE

| | | |
|---------------------------------|------------------------------|----------------|
| Año académico | 2018-19 | |
| Estudio | Máster en Finanzas (EM99) | |
| Nombre de la asignatura | PRODUCTOS FINANCIEROS | |
| Carácter (Obligatoria/Optativa) | Obligatoria | |
| Créditos (1 ECTS=25 horas) | 6 | |
| Modalidad (elegir una opción) | X | Presencial |
| | | Semipresencial |
| | | On-line |
| Profesor responsable | José Ignacio Olmeda Martos | |
| Idioma en el que se imparte | Español | |

DISTRIBUCIÓN DE CRÉDITOS (especificar en horas)

| | |
|--|-----|
| Número de horas presenciales/on-line asistencia profesor | 42 |
| Número de horas de trabajo personal del estudiante | 108 |
| Total horas | 150 |

CONTENIDOS (Temario)

- Valoración de Bonos e Instrumentos de Renta Fija
- Valoración Acciones e Instrumentos de Renta Variable
- Valoración de Opciones, Futuros Financieros y Derivados Financieros.

EVALUACIÓN

El programa evalúa los aprendizajes mediante Pruebas de Evaluación Continua (PEC) de carácter teórico-práctico. Estas pruebas se programan en cada asignatura e incluyen los criterios de evaluación para los mismos.

BIBLIOGRAFÍA

Referencia Básica:

- Zvi Bodie and Alex Kane and Alan Marcus (214): *Investments*, McGraw Hill.

GUÍA DOCENTE

| | | |
|---------------------------------|-------------------------------|----------------|
| Año académico | 2018-19 | |
| Estudio | Máster en Finanzas (EM99) | |
| Nombre de la asignatura | ECONOMÍA INTERNACIONAL | |
| Carácter (Obligatoria/Optativa) | Obligatoria | |
| Créditos (1 ECTS=25 horas) | 3 | |
| Modalidad (elegir una opción) | X | Presencial |
| | | Semipresencial |
| | | On-line |
| Profesor responsable | José Ignacio Olmeda Martos | |
| Idioma en el que se imparte | Español | |

DISTRIBUCIÓN DE CRÉDITOS (especificar en horas)

| | |
|--|----|
| Número de horas presenciales/on-line asistencia profesor | 21 |
| Número de horas de trabajo personal del estudiante | 54 |
| Total horas | 75 |

CONTENIDOS (Temario)

- Empleo y Crecimiento.
- Organismos internacionales.
- Marco económico internacional

EVALUACIÓN

El programa evalúa los aprendizajes mediante Pruebas de Evaluación Continua (PEC) de carácter teórico-práctico. Estas pruebas se programan en cada asignatura e incluyen los criterios de evaluación para los mismos.

BIBLIOGRAFÍA

Referencia Básica:

- Thomas A Pugel (2012): *International Economics*. McGraw Hill.

GUÍA DOCENTE

| | | |
|---------------------------------|----------------------------------|----------------|
| Año académico | 2018-19 | |
| Estudio | Máster en Finanzas (EM99) | |
| Nombre de la asignatura | ESTADÍSTICA Y ECONOMETRÍA | |
| Carácter (Obligatoria/Optativa) | Obligatoria | |
| Créditos (1 ECTS=25 horas) | 3 | |
| Modalidad (elegir una opción) | X | Presencial |
| | | Semipresencial |
| | | On-line |
| Profesor responsable | José Ignacio Olmeda Martos | |
| Idioma en el que se imparte | Español | |

DISTRIBUCIÓN DE CRÉDITOS (especificar en horas)

| | |
|--|----|
| Número de horas presenciales/on-line asistencia profesor | 21 |
| Número de horas de trabajo personal del estudiante | 54 |
| Total horas | 75 |

CONTENIDOS (Temario)

- Modelos Lineales.
- Contrastes de Hipótesis.
- Modelos no lineales.

EVALUACIÓN

El programa evalúa los aprendizajes mediante Pruebas de Evaluación Continua (PEC) de carácter teórico-práctico. Estas pruebas se programan en cada asignatura e incluyen los criterios de evaluación para los mismos.

BIBLIOGRAFÍA

Referencia Básica:

- James.D. Hamilton (1994): *Time Series Analysis*. Princeton University Press.

GUÍA DOCENTE

| | | |
|---------------------------------|--------------------------------|----------------|
| Año académico | 2018-19 | |
| Estudio | Máster en Finanzas (EM99) | |
| Nombre de la asignatura | CONTABILIDAD FINANCIERA | |
| Carácter (Obligatoria/Optativa) | Obligatoria | |
| Créditos (1 ECTS=25 horas) | 3 | |
| Modalidad (elegir una opción) | X | Presencial |
| | | Semipresencial |
| | | On-line |
| Profesor responsable | José Ignacio Olmeda Martos | |
| Idioma en el que se imparte | Español | |

DISTRIBUCIÓN DE CRÉDITOS (especificar en horas)

| | |
|--|----|
| Número de horas presenciales/on-line asistencia profesor | 21 |
| Número de horas de trabajo personal del estudiante | 54 |
| Total horas | 75 |

CONTENIDOS (Temario)

- Estados Financieros
- Ratios Financieros
- Análisis Financiero

EVALUACIÓN

El programa evalúa los aprendizajes mediante Pruebas de Evaluación Continua (PEC) de carácter teórico-práctico. Estas pruebas se programan en cada asignatura e incluyen los criterios de evaluación para los mismos.

BIBLIOGRAFÍA

Referencia Básica:

-

Fred Phillips: (2015): *Fundamentals of Financial Accounting*. McGraw Hill.

GUÍA DOCENTE

| | | |
|---------------------------------|----------------------------|----------------|
| Año académico | 2018-19 | |
| Estudio | Máster en Finanzas (EM99) | |
| Nombre de la asignatura | RIESGOS FINANCIEROS | |
| Carácter (Obligatoria/Optativa) | Obligatoria | |
| Créditos (1 ECTS=25 horas) | 6 | |
| Modalidad (elegir una opción) | X | Presencial |
| | | Semipresencial |
| | | On-line |
| Profesor responsable | José Ignacio Olmeda Martos | |
| Idioma en el que se imparte | Español | |

DISTRIBUCIÓN DE CRÉDITOS (especificar en horas)

| | |
|--|-----|
| Número de horas presenciales/on-line asistencia profesor | 42 |
| Número de horas de trabajo personal del estudiante | 108 |
| Total horas | 150 |

CONTENIDOS (Temario)

- Valor en Riesgo
- Riesgo de Mercado
- Riesgo de Crédito
- *Stress y Backtesting*

EVALUACIÓN

El programa evalúa los aprendizajes mediante Pruebas de Evaluación Continua (PEC) de carácter teórico-práctico. Estas pruebas se programan en cada asignatura e incluyen los criterios de evaluación para los mismos.

BIBLIOGRAFÍA

Referencia Básica:

-

John Hull (2018): *Risk Management and Financial Institutions*. Wiley

GUÍA DOCENTE

| | | |
|---------------------------------|--------------------------------|----------------|
| Año académico | 2018-19 | |
| Estudio | Máster en Finanzas (EM99) | |
| Nombre de la asignatura | METODOS COMPUTACIONALES | |
| Carácter (Obligatoria/Optativa) | Obligatoria | |
| Créditos (1 ECTS=25 horas) | 6 | |
| Modalidad (elegir una opción) | X | Presencial |
| | | Semipresencial |
| | | On-line |
| Profesor responsable | José Ignacio Olmeda Martos | |
| Idioma en el que se imparte | Español | |

DISTRIBUCIÓN DE CRÉDITOS (especificar en horas)

| | |
|--|-----|
| Número de horas presenciales/on-line asistencia profesor | 42 |
| Número de horas de trabajo personal del estudiante | 108 |
| Total horas | 150 |

CONTENIDOS (Temario)

- Fundamentos de Programación
- Introducción al Lenguaje R
- Introducción al lenguaje Python
- Aplicaciones financieras

EVALUACIÓN

El programa evalúa los aprendizajes mediante Pruebas de Evaluación Continua (PEC) de carácter teórico-práctico. Estas pruebas se programan en cada asignatura e incluyen los criterios de evaluación para los mismos.

BIBLIOGRAFÍA

Referencia Básica:

-

Wes McKinney (2017): Python for Data Analysis: *Data Wrangling with Pandas, NumPy, and IPython*. O'Reilly.

GUÍA DOCENTE

| | | |
|---------------------------------|------------------------------|----------------|
| Año académico | 2018-19 | |
| Estudio | Máster en Finanzas (EM99) | |
| Nombre de la asignatura | FINANZAS CORPORATIVAS | |
| Carácter (Obligatoria/Optativa) | Obligatoria | |
| Créditos (1 ECTS=25 horas) | 6 | |
| Modalidad (elegir una opción) | X | Presencial |
| | | Semipresencial |
| | | On-line |
| Profesor responsable | José Ignacio Olmeda Martos | |
| Idioma en el que se imparte | Español | |

DISTRIBUCIÓN DE CRÉDITOS (especificar en horas)

| | |
|--|-----|
| Número de horas presenciales/on-line asistencia profesor | 42 |
| Número de horas de trabajo personal del estudiante | 108 |
| Total horas | 150 |

CONTENIDOS (Temario)

- Modelos de flujos de caja
- Estructura Financiera
- Valoración avanzada

EVALUACIÓN

El programa evalúa los aprendizajes mediante Pruebas de Evaluación Continua (PEC) de carácter teórico-práctico. Estas pruebas se programan en cada asignatura e incluyen los criterios de evaluación para los mismos.

BIBLIOGRAFÍA

Referencia básica:

- Stephen Ross y Franco Modigliani (2016): *Fundamentals of Corporate Finance*, Mc Graw Hill.

GUÍA DOCENTE

| | | |
|---------------------------------|---|----------------|
| Año académico | 2018-19 | |
| Estudio | Máster en Finanzas (EM99) | |
| Nombre de la asignatura | TRANSFORMACIÓN DIGITAL EN BANCA Y MERCADOS FINANCIEROS | |
| Carácter (Obligatoria/Optativa) | Obligatoria | |
| Créditos (1 ECTS=25 horas) | 3 | |
| Modalidad (elegir una opción) | X | Presencial |
| | | Semipresencial |
| | | On-line |
| Profesor responsable | José Ignacio Olmeda Martos | |
| Idioma en el que se imparte | Español | |

DISTRIBUCIÓN DE CRÉDITOS (especificar en horas)

| | |
|--|----|
| Número de horas presenciales/on-line asistencia profesor | 21 |
| Número de horas de trabajo personal del estudiante | 54 |
| Total horas | 75 |

CONTENIDOS (Temario)

- Innovación Financiera
- Mercados electrónicos
- Banco del Futuro
- Modelos de Negocio en FINTECH

EVALUACIÓN

El programa evalúa los aprendizajes mediante Pruebas de Evaluación Continua (PEC) de carácter teórico-práctico. Estas pruebas se programan en cada asignatura e incluyen los criterios de evaluación para los mismos.

BIBLIOGRAFÍA

Referencia Básica:

- Paulo Sironi (2016): *FinTech Innovation: From Robo-Advisors to Goal Based Investing and Gamification*, Wiley

GUÍA DOCENTE

| | | |
|---------------------------------|---|----------------|
| Año académico | 2018-19 | |
| Estudio | Máster en Finanzas (EM99) | |
| Nombre de la asignatura | GESTIÓN DE CARTERAS DE INVERSIÓN | |
| Carácter (Obligatoria/Optativa) | Obligatoria | |
| Créditos (1 ECTS=25 horas) | 3 | |
| Modalidad (elegir una opción) | X | Presencial |
| | | Semipresencial |
| | | On-line |
| Profesor responsable | José Ignacio Olmeda Martos | |
| Idioma en el que se imparte | Español | |

DISTRIBUCIÓN DE CRÉDITOS (especificar en horas)

| | |
|--|----|
| Número de horas presenciales/on-line asistencia profesor | 21 |
| Número de horas de trabajo personal del estudiante | 54 |
| Total horas | 75 |

CONTENIDOS (Temario)

- Modelo de Markowitz
- CAPM y APT
- Gestión pasiva
- Medidas de *performance*

EVALUACIÓN

El programa evalúa los aprendizajes mediante Pruebas de Evaluación Continua (PEC) de carácter teórico-práctico. Estas pruebas se programan en cada asignatura e incluyen los criterios de evaluación para los mismos.

BIBLIOGRAFÍA

Referencia Básica:

- Frank Reilly, Keith Brown, Sanford Leeds (2018): *Investment Analysis and Portfolio Management*, South Western College Pub.

GUÍA DOCENTE

| | | |
|---------------------------------|----------------------------|----------------|
| Año académico | 2018-19 | |
| Estudio | Máster en Finanzas (EM99) | |
| Nombre de la asignatura | SEMINARIOS | |
| Carácter (Obligatoria/Optativa) | Obligatoria | |
| Créditos (1 ECTS=25 horas) | 3 | |
| Modalidad (elegir una opción) | X | Presencial |
| | | Semipresencial |
| | | On-line |
| Profesor responsable | José Ignacio Olmeda Martos | |
| Idioma en el que se imparte | Español | |

DISTRIBUCIÓN DE CRÉDITOS (especificar en horas)

| | |
|--|----|
| Número de horas presenciales/on-line asistencia profesor | 21 |
| Número de horas de trabajo personal del estudiante | 54 |
| Total horas | 75 |

CONTENIDOS (Temario)

- Temas diversos de actualidad en las Finanzas

EVALUACIÓN

El programa evalúa los aprendizajes mediante Pruebas de Evaluación Continua (PEC) de carácter teórico-práctico. Estas pruebas se programan en cada asignatura e incluyen los criterios de evaluación para los mismos.

BIBLIOGRAFÍA

Artículos de opinión de revistas de prestigio como *MIT Sloan Management Review*, *Harvard Business Review*, *Wired*, *MIT Technology Review*, etc.

GUÍA DOCENTE

| | | |
|---------------------------------|------------------------------|----------------|
| Año académico | 2018-19 | |
| Estudio | Máster en Finanzas (EM99) | |
| Nombre de la asignatura | REGULACIÓN FINANCIERA | |
| Carácter (Obligatoria/Optativa) | Optativa | |
| Créditos (1 ECTS=25 horas) | 3 | |
| Modalidad (elegir una opción) | X | Presencial |
| | | Semipresencial |
| | | On-line |
| Profesor responsable | José Ignacio Olmeda Martos | |
| Idioma en el que se imparte | Español | |

DISTRIBUCIÓN DE CRÉDITOS (especificar en horas)

| | |
|--|----|
| Número de horas presenciales/on-line asistencia profesor | 21 |
| Número de horas de trabajo personal del estudiante | 54 |
| Total horas | 75 |

CONTENIDOS (Temario)

- Regulación Bancaria
- Basilea 2, 3 y 4.
- Medios de Pago y PSD2.

EVALUACIÓN

El programa evalúa los aprendizajes mediante Pruebas de Evaluación Continua (PEC) de carácter teórico-práctico. Estas pruebas se programan en cada asignatura e incluyen los criterios de evaluación para los mismos.

BIBLIOGRAFÍA

Referencia Básica:

- Ali Hashmi (2018): *European Financial Regulation - MiFID II: An Introduction to European Financial Regulatory Framework and Key Changes introduced by MiFID II*, Amazon Digital Services.

GUÍA DOCENTE

| | | |
|---------------------------------|--|----------------|
| Año académico | 2018-19 | |
| Estudio | Máster en Finanzas (EM99) | |
| Nombre de la asignatura | VALORACIÓN DE EMPRESAS Y FUSIONES | |
| Carácter (Obligatoria/Optativa) | Optativa | |
| Créditos (1 ECTS=25 horas) | 3 | |
| Modalidad (elegir una opción) | X | Presencial |
| | | Semipresencial |
| | | On-line |
| Profesor responsable | José Ignacio Olmeda Martos | |
| Idioma en el que se imparte | Español | |

DISTRIBUCIÓN DE CRÉDITOS (especificar en horas)

| | |
|--|----|
| Número de horas presenciales/on-line asistencia profesor | 21 |
| Número de horas de trabajo personal del estudiante | 54 |
| Total horas | 75 |

CONTENIDOS (Temario)

- Métodos de Valoración
- LBO, Fusiones y Adquisiciones
- Evaluación de Operaciones Corporativas

EVALUACIÓN

El programa evalúa los aprendizajes mediante Pruebas de Evaluación Continua (PEC) de carácter teórico-práctico. Estas pruebas se programan en cada asignatura e incluyen los criterios de evaluación para los mismos.

BIBLIOGRAFÍA

Referencia Básica:

- Aswath Damodaran (2015): *Damodaran on Valuation: Security Analysis for Investment and Corporate Finance*, Wiley.

GUÍA DOCENTE

| | | |
|---------------------------------|-------------------------------------|----------------|
| Año académico | 2018-19 | |
| Estudio | Máster en Finanzas (EM99) | |
| Nombre de la asignatura | INSTRUMENTOS DE FINANCIACIÓN | |
| Carácter (Obligatoria/Optativa) | Optativa | |
| Créditos (1 ECTS=25 horas) | 3 | |
| Modalidad (elegir una opción) | X | Presencial |
| | | Semipresencial |
| | | On-line |
| Profesor responsable | José Ignacio Olmeda Martos | |
| Idioma en el que se imparte | Español | |

DISTRIBUCIÓN DE CRÉDITOS (especificar en horas)

| | |
|--|----|
| Número de horas presenciales/on-line asistencia profesor | 21 |
| Número de horas de trabajo personal del estudiante | 54 |
| Total horas | 75 |

CONTENIDOS (Temario)

- Financiación con Recurso
- Financiación sin recurso

EVALUACIÓN

El programa evalúa los aprendizajes mediante Pruebas de Evaluación Continua (PEC) de carácter teórico-práctico. Estas pruebas se programan en cada asignatura e incluyen los criterios de evaluación para los mismos.

BIBLIOGRAFÍA

Referencia Básica:

- John D Finnerty (2015): *Project Financing: Asset-Based Financial Engineering*, Wiley.

GUÍA DOCENTE

| | | |
|---------------------------------|----------------------------|----------------|
| Año académico | 2018-19 | |
| Estudio | Máster en Finanzas (EM99) | |
| Nombre de la asignatura | AUDITORÍA | |
| Carácter (Obligatoria/Optativa) | Optativa | |
| Créditos (1 ECTS=25 horas) | 3 | |
| Modalidad (elegir una opción) | X | Presencial |
| | | Semipresencial |
| | | On-line |
| Profesor responsable | José Ignacio Olmeda Martos | |
| Idioma en el que se imparte | Español | |

DISTRIBUCIÓN DE CRÉDITOS (especificar en horas)

| | |
|--|----|
| Número de horas presenciales/on-line asistencia profesor | 21 |
| Número de horas de trabajo personal del estudiante | 54 |
| Total horas | 75 |

CONTENIDOS (Temario)

- Pruebas de Auditoría
- Elaboración de Informes

EVALUACIÓN

El programa evalúa los aprendizajes mediante Pruebas de Evaluación Continua (PEC) de carácter teórico-práctico. Estas pruebas se programan en cada asignatura e incluyen los criterios de evaluación para los mismos.

BIBLIOGRAFÍA

Referencia Básica:

- William F Messier, Steven M Glover y Douglas F Prawitt (2017): *Auditing & Assurance Services: A Systematic Approach*, Mc Graw Hill.

GUÍA DOCENTE

| | | |
|---------------------------------|------------------------------|----------------|
| Año académico | 2018-19 | |
| Estudio | Máster en Finanzas (EM99) | |
| Nombre de la asignatura | PROCESOS ESTOCÁSTICOS | |
| Carácter (Obligatoria/Optativa) | Optativa | |
| Créditos (1 ECTS=25 horas) | 3 | |
| Modalidad (elegir una opción) | X | Presencial |
| | | Semipresencial |
| | | On-line |
| Profesor responsable | José Ignacio Olmeda Martos | |
| Idioma en el que se imparte | Español | |

DISTRIBUCIÓN DE CRÉDITOS (especificar en horas)

| | |
|--|----|
| Número de horas presenciales/on-line asistencia profesor | 21 |
| Número de horas de trabajo personal del estudiante | 54 |
| Total horas | 75 |

CONTENIDOS (Temario)

- Procesos Brownianos y Martingalas
- Cálculo Estocástico
- Resultados Estocásticos Fundamentales (Feynman-Kac,...)

EVALUACIÓN

El programa evalúa los aprendizajes mediante Pruebas de Evaluación Continua (PEC) de carácter teórico-práctico. Estas pruebas se programan en cada asignatura e incluyen los criterios de evaluación para los mismos.

BIBLIOGRAFÍA

Referencia básica:

- Wolfgang Paul y Jorg Baschnagel (2013): *Stochastic Processes*, Springer.

GUÍA DOCENTE

| | | |
|---------------------------------|----------------------------|----------------|
| Año académico | 2018-19 | |
| Estudio | Máster en Finanzas (EM99) | |
| Nombre de la asignatura | TRADING ALGORITMICO | |
| Carácter (Obligatoria/Optativa) | Optativa | |
| Créditos (1 ECTS=25 horas) | 3 | |
| Modalidad (elegir una opción) | X | Presencial |
| | | Semipresencial |
| | | On-line |
| Profesor responsable | José Ignacio Olmeda Martos | |
| Idioma en el que se imparte | Español | |

DISTRIBUCIÓN DE CRÉDITOS (especificar en horas)

| | |
|--|----|
| Número de horas presenciales/on-line asistencia profesor | 21 |
| Número de horas de trabajo personal del estudiante | 54 |
| Total horas | 75 |

CONTENIDOS (Temario)

- Mercados de Alta Frecuencia
- Estrategias de Pares y otros
- Modelos basados en *Machine Learning*

EVALUACIÓN

El programa evalúa los aprendizajes mediante Pruebas de Evaluación Continua (PEC) de carácter teórico-práctico. Estas pruebas se programan en cada asignatura e incluyen los criterios de evaluación para los mismos.

BIBLIOGRAFÍA

Referencia básica:

- Ernie Chan (2013): *Algorithmic Trading: Winning Strategies and Their Rationale*, Wiley

GUÍA DOCENTE

| | | |
|---------------------------------|----------------------------|----------------|
| Año académico | 2018-19 | |
| Estudio | Máster en Finanzas (EM99) | |
| Nombre de la asignatura | BANCA DE INVERSIÓN | |
| Carácter (Obligatoria/Optativa) | Optativa | |
| Créditos (1 ECTS=25 horas) | 3 | |
| Modalidad (elegir una opción) | X | Presencial |
| | | Semipresencial |
| | | On-line |
| Profesor responsable | José Ignacio Olmeda Martos | |
| Idioma en el que se imparte | Español | |

DISTRIBUCIÓN DE CRÉDITOS (especificar en horas)

| | |
|--|----|
| Número de horas presenciales/on-line asistencia profesor | 21 |
| Número de horas de trabajo personal del estudiante | 54 |
| Total horas | 75 |

CONTENIDOS (Temario)

- Diseño y Valoración de Emisiones
- Research
- Modelos avanzados

EVALUACIÓN

El programa evalúa los aprendizajes mediante Pruebas de Evaluación Continua (PEC) de carácter teórico-práctico. Estas pruebas se programan en cada asignatura e incluyen los criterios de evaluación para los mismos.

BIBLIOGRAFÍA

Referencia básica:

- Joshua Rosenbaum y Joshua Pearl (2013): *Investment Banking Valuation Models*, Wiley.

GUÍA DOCENTE

| | | |
|---------------------------------|----------------------------|----------------|
| Año académico | 2018-19 | |
| Estudio | Máster en Finanzas (EM99) | |
| Nombre de la asignatura | GESTIÓN PATRIMONIAL | |
| Carácter (Obligatoria/Optativa) | Optativa | |
| Créditos (1 ECTS=25 horas) | 3 | |
| Modalidad (elegir una opción) | X | Presencial |
| | | Semipresencial |
| | | On-line |
| Profesor responsable | José Ignacio Olmeda Martos | |
| Idioma en el que se imparte | Español | |

DISTRIBUCIÓN DE CRÉDITOS (especificar en horas)

| | |
|--|----|
| Número de horas presenciales/on-line asistencia profesor | 21 |
| Número de horas de trabajo personal del estudiante | 54 |
| Total horas | 75 |

CONTENIDOS (Temario)

- Análisis de Cliente
- Análisis de Productos
- Aspectos Impositivos

EVALUACIÓN

El programa evalúa los aprendizajes mediante Pruebas de Evaluación Continua (PEC) de carácter teórico-práctico. Estas pruebas se programan en cada asignatura e incluyen los criterios de evaluación para los mismos.

BIBLIOGRAFÍA

Referencia básica:

- Jean L.P. Brunel (2015): *Goals-Based Wealth Management: An Integrated and Practical Approach to Changing the Structure of Wealth Advisory Practices*, Wiley

GUÍA DOCENTE

| | | |
|---------------------------------|------------------------------|----------------|
| Año académico | 2018-19 | |
| Estudio | Máster en Finanzas (EM99) | |
| Nombre de la asignatura | TRABAJO FIN DE MÁSTER | |
| Carácter (Obligatoria/Optativa) | Obligatoria | |
| Créditos (1 ECTS=25 horas) | 6 | |
| Modalidad (elegir una opción) | X | Presencial |
| | | Semipresencial |
| | | On-line |
| Profesor responsable | José Ignacio Olmeda Martos | |
| Idioma en el que se imparte | Español | |

DISTRIBUCIÓN DE CRÉDITOS (especificar en horas)

| | |
|--|-----|
| Número de horas presenciales/on-line asistencia profesor | 42 |
| Número de horas de trabajo personal del estudiante | 108 |
| Total horas | 150 |

CONTENIDOS (Temario)

- Preparación, edición y defensa de un trabajo de investigación o aplicado sobre los contenidos del Master

EVALUACIÓN

Defensa ante tribunal

BIBLIOGRAFÍA

Dependiendo del contenido alguna o algunas de las referencias anteriormente indicadas