



Universidad
de Alcalá

GUÍA DOCENTE

EXCEL AVANZADO PARA LAS FINANZAS

**Grado en Administración y Dirección de
Empresas**

Grado en Contabilidad y Finanzas

Universidad de Alcalá

Curso Académico 2018/19

(optativa)

GUÍA DOCENTE

Nombre de la asignatura:	Excel avanzado para las finanzas
Código	340085
Titulación en la que se imparte:	Grado en Administración y Dirección de Empresas Grado en Contabilidad y Finanzas
Departamento y área de conocimiento	Economía y Dirección de Empresas Economía Financiera
Carácter	Optativa
Créditos ECTS:	6
Curso y Cuatrimestre	Primer cuatrimestre
Profesorado:	Pilar Requena (pilar.requena@uah.es)
Horario de Tutoría	Se indicará el primer día de clase
Idioma en que se imparte:	Español

SUMMARY OF THIS COURSE

This course is offered in Spanish only.

This course of Advanced Excel applied for Finance is designed for those with a background on financial or business mathematics, and who have followed at least one course on Excel or Excel applied for Finance.

The topics of the course are Visual Basic for Application (VBA) and the application to financial problems like financial risk management and portfolio management.

PRESENTACIÓN

Es una asignatura optativa, adscrita al Departamento de Economía y Dirección de Empresas.

El objetivo fundamental de esta asignatura es aprender programación en Visual Basic para Aplicaciones (VBA), y su aplicación en el análisis y resolución de problemas de valoración financiera y gestión de riesgos financieros.

CONOCIMIENTOS PREVIOS

Relación con otras asignaturas de la misma titulación:

Se recomienda haber cursado las siguientes asignaturas de esta titulación:

- Matemáticas Empresariales I
- Matemáticas Empresariales II
- Análisis de las Operaciones Financieras
- Dirección Financiera I
- Teoría de los Mercados Financieros
- Excel para las finanzas

COMPETENCIAS

Competencias genéricas

- Capacidad de análisis y síntesis
- Capacidad de trabajo autónomo y colaborativo
- Capacidad de diseño y desarrollo de aplicaciones informáticas sencillas

Competencias específicas

- Capacidad para la utilización de medios informáticos y, en concreto, de las hojas de cálculo para el planteamiento y solución de problemas financieros.
- Capacidad para desarrollar aplicaciones informáticas personalizadas utilizables en la valoración financiera y gestión de riesgos financieros.

RESULTADOS DE APRENDIZAJE

- Conocimiento de las herramientas informáticas (Excel y VBA) más comúnmente utilizadas para el tratamiento, gestión y análisis de la información cuantitativa.
- Elaboración y aplicación de modelos informáticos personalizados para la valoración financiera y gestión de riesgos financieros.

CONTENIDOS

Parte I –VISUAL BASIC PARA APLICACIONES (VBA)

Tema 1. Introducción a VBA

Tema 2: VBA: Variables, objetos, estructuras de control.

Parte II –MODELIZACIÓN FINANCIERA UTILIZANDO VBA

Tema 3. Valoración financiera

Tema 4. Simulación en finanzas

Tema 5. Derivados financieros.

VOLUMEN DE TRABAJO

	Horas
ACTIVIDADES PRESENCIALES	
Prácticas en aula informática	30,0
Clases de teoría (en el aula informática)	15,0
Examen final	3,0
Total Actividades Presenciales	48,0
ACTIVIDADES NO PRESENCIALES	
Elaboración de trabajos individuales	10,0
Estudio y trabajo autónomo	40,0
Preparación de clases de teoría	26,0
Preparación de clases prácticas y de problemas	26,0
Total Actividades No Presenciales	102
TOTAL ASIGNATURA	150

METODOLOGÍA DOCENTE

El desarrollo de la asignatura se estructura en torno a las sesiones teóricas y prácticas y a los propios trabajos realizados por el alumno.

Las clases se llevarán a cabo en el aula de informática, y desde el primer momento los alumnos tendrán que trabajar con el ordenador.

En cada sesión se presentarán la parte teórica de los conceptos introducidos, y su aplicación práctica a supuestos y problemas financieros. A continuación, el profesor propondrá problemas relacionados con la valoración financiera y la gestión de riesgos para que el alumno los resuelva utilizando VBA.

EVALUACIÓN

Consideraciones generales

1. De acuerdo con lo establecido en la normativa reguladora de los procesos de evaluación de los aprendizajes, aprobada en sesión de 24 de marzo de 2011, el criterio inspirador de la programación docente es la evaluación continua del estudiante durante todo el proceso de aprendizaje de la asignatura.
2. En cada curso académico el estudiante tendrá derecho a disponer de dos convocatorias, una ordinaria y otra extraordinaria.
3. La convocatoria ordinaria estará basada en la evaluación continua, salvo en el caso de aquellos estudiantes que tengan reconocido el derecho a la evaluación final.
4. Para que un estudiante pueda acogerse a la evaluación final, tendrá que solicitarlo por escrito al Decan@ de la Facultad, en las dos primeras semanas de impartición de la asignatura, explicando las razones que le impiden seguir el sistema de evaluación continua.
5. Todo estudiante que no supere la asignatura por el sistema de evaluación continua, tendrá derecho a la evaluación final en convocatoria extraordinaria, que consistirá en un examen.

EVALUACIÓN CONTINUA

El rendimiento de los alumnos será evaluado por su trabajo, y por las competencias y los conocimientos que hayan adquirido. Los criterios y procedimientos a tener en cuenta serán:

Criterios de Evaluación

A fin de obtener una evaluación completa del alumno, habrá de observarse que éste:

Identifica las ideas principales de cada uno de los contenidos.

Relaciona y aplica los contenidos nuevos con los ya sabidos.

Comprende los conceptos básicos.

Aplica los contenidos a situaciones diversas.

Resuelve los problemas de modo comprensivo.

Aplica el sentido crítico al analizar y solucionar el problema.

Integra los diferentes conocimientos.

Presenta los ejercicios con claridad, corrección y cuidado expositivo, en la forma y tiempo acordados.

Elabora modelos en los que utiliza los conocimientos vistos.

Y en cuanto a sus trabajos y aportaciones prácticas, se valorará:

Originalidad y aportaciones del trabajo.

Rigor en la presentación.

Integración y coherencia teórico-práctica.

Capacidad de análisis

Procedimiento de Evaluación

La asistencia y trabajo en clase es obligatorio, y supone el 25% de la calificación. Para que el alumno pueda obtener la máxima calificación en este ítem ha de asistir, como mínimo, a 14 sesiones de tres horas o bien 28 sesiones de hora y media.

Resolución de supuestos prácticos incluidos en la carpeta de prácticas del alumno. La carpeta de prácticas de cada alumno incluye algunos ejercicios que sólo estarán disponibles para los alumnos que asistan a clase: 40% de la calificación total

Examen final teórico-práctico 35% de la calificación final.

Si el estudiante no participa en el proceso de enseñanza-aprendizaje según lo establecido para la evaluación continua, se considerará no presentado en la convocatoria ordinaria.

Si en la convocatoria ordinaria no se supera la asignatura, no se guarda la nota de las actividades de la evaluación continua y el método de evaluación será un examen final en convocatoria extraordinaria.

EVALUACIÓN FINAL

La evaluación final consistirá en un examen final que constará de dos partes: una parte teórica y una parte práctica, en las que el alumno tendrá que demostrar que ha

adquirido las competencias genéricas y específicas de la asignatura. Además, es obligatoria la entrega de una carpeta de supuestos prácticos, que el profesor entregará al alumno al comienzo del curso

Sistema de calificación

Según el R.D 1125/2003 que regula el Suplemento al Título las calificaciones deberán seguir la escala de adopción de notas numéricas con un decimal y una calificación cualitativa:

0,0 - 4,9 SUSPENSO (SS)

5,0 - 6,9 APROBADO (AP)

7,0- 8,9 NOTABLE (NT)

9,0 – 10 SOBRESALIENTE (SB)

9,0 – 10 MATRÍCULA DE HONOR limitada al 5%

BIBLIOGRAFIA

Charte Ojeda, Francisco (2016): *Manual Excel 2016*, Anaya Multimedia, Madrid

Davison, Matt (2014): *Quantitative finance: a simulation-based introduction using Excel*, Chapman and Hall/CRC (biblioteca online UAH)

Holden, Craig W. (2015): *Excel modeling in investments*, Ed Pearson.

Jackson, Mary (2006): “Advanced Modelling in Finance using Excel and VBA” John Wiley & Sons

Jelen, B; Syrstad, T. (2015): *Excel 2016: VBA and Macros*, Ed Que, (biblioteca online UAH)

Morgado, F. (2016): *Programming Excel with VBA: A practical real-world guide*, Ed Apress (biblioteca online UAH)

Nelson, S.L, Nelson, E.C.(2016): *Excel data analysis for dummies*, John Wiley & Sons, (biblioteca online UAH).

Sengupta, Chandan (2009): “Financial Analysis and Modeling Using Excel and VBA”, John Wiley & Sons