



DATOS IDENTIFICATIVOS

Modelos Matemáticos en Finanzas

Materia	Modelos Matemáticos en Finanzas			
Código	V05M135V01206			
Titulación	Máster Universitario en Matemática Industrial			
Descritores	Creditos ECTS	Sinale	Curso	Cuadrimestre
	6	OP	1	2c
Lingua de impartición				
Departamento	Dpto. Externo Matemática aplicada II			
Coordinador/a	Durany Castrillo, José			
Profesorado	Durany Castrillo, José Moreno González, Carlos Rodríguez Nogueiras, María Vázquez Cendón, Carlos			
Correo-e	durany@dma.uvigo.es			
Web	http://www.m2i.es/docs/modulos/ModelosFinanzas.pdf			
Descrición xeral	<ol style="list-style-type: none"> 1. Mercados financeiros e produtos financeiros derivados. 2. Valor actualizado de produtos sin risco. 3. Modelos de prezos de activos con risco. 4. Técnica de cobertura dinámica e modelos de Black-Scholes. 5. Modelos Black-Scholes para opcións e bonos con un factor estocástico 6. Modelos Black-Scholes para opcións e bonos con dous factores estocásticos 7. Calculo de riscos financeiros: risco de valoración e de contraparte: Definicións, metodoloxía e uso. 			

Competencias de titulación

Código

Competencias de materia

Resultados previstos na materia	Tipoloxía	Resultados de Formación e Aprendizaxe

Contidos

Tema

Planificación

	Horas na aula	Horas fóra da aula	Horas totais
*Os datos que aparecen na táboa de planificación son de carácter orientador, considerando a heteroxeneidade do alumnado.			

Metodoloxía docente

Descrición

Atención personalizada

Avaliación

Descrición	Cualificación

Outros comentarios sobre a Avaliación

Bibliografía. Fontes de información

Recomendacións
