

## Gestió financera

Codi: 100133  
Crèdits: 6

2024/2025

Titulació	Tipus	Curs
2500149 Matemàtiques	OT	4

### Professor/a de contacte

Nom: Albert Ferreiro Castilla

Correu electrònic: albert.ferreiro@uab.cat

### Idiomes dels grups

Podeu consultar aquesta informació al [final](#) del document.

### Prerequisits

L'assignatura és una continuació natural de l'assignatura Introducció a l'Enginyeria Financera i es per això que és recomanable però no obligatori que l'alumne tingui assolits els coneixements bàsics d'aquesta assignatura. Sí és recomanable tenir assolits els coneixements teòrics bàsics de càlcul, càlcul de probabilitats, i mètodes numèrics adquirits ens cursos anteriors.

### Objectius

L'objectiu d'aquesta assignatura es introduir l'estudiant en un àrea molt activa tant científicament com professionalment com és la matemàtica financera. L'objectiu formatiu principal és aprofundir en la descripció dels diferents actius financers així com mostrar les eines i conceptes matemàtics i estadístics que s'empren per la seva gestió, incidint en la seva correcta utilització i interpretació dels resultats.

És per això que requereix que l'estudiant tingui assolits els coneixements teòrics i pràctics de l'assignatura Introducció a l'Enginyeria Financera així com els conceptes bàsics de càlcul, càlcul de probabilitats i mètodes numèrics.

Així l'assignatura es planteja com un primer curs en derivats financers, incidint en la descripció dels més rellevants en el mercat, el seu ús i la seva valoració. Des de fa més de 40 anys els derivats financers han jugat un paper molt rellevant per mitigar el risc, especular o arbitrar mercats i han estat una peça fonamental en la transferència de risc entre agents econòmics. És per aquest motiu que els derivats financers també han estat en el centre de diferents crisis financeres.

És també un objectiu que l'alumne faci un treball que requereixi l'ordinador, això ens portarà a complementar les classes de teoria amb classes de problemes i unes pràctiques on l'ordinador estigui present.

### Competències

- Comprendre i utilitzar el llenguatge matemàtic
- Desenvolupar un pensament i un raonament crític i saber comunicar-ho de manera efectiva, tant en les llengües pròpies com en una tercera llengua

- Distingir, davant d'un problema o situació, el que és substancial del qual és purament ocasional o circumstancial.
- Que els estudiants hagin desenvolupat les habilitats d'aprenentatge necessàries per a emprendre estudis posteriors amb un alt grau d'autonomia.
- Que els estudiants puguin transmetre informació idees, problemes i solucions a un públic tan especialitzat com no especialitzat
- Que els estudiants sàpiguen aplicar els seus coneixements al seu treball o vocació d'una forma professional i posseeixin les competències que solen demostrar-se per mitjà de l'elaboració i defensa d'arguments i la resolució de problemes dins de la seva àrea d'estudi.
- Que els estudiants tinguin la capacitat de reunir i interpretar dades rellevants (normalment dins de la seva àrea d'estudi) per emetre judicis que incloguin una reflexió sobre temes rellevants d'índole social, científica o ètica.
- Reconèixer la presència de les Matemàtiques en altres disciplines
- Utilitzar eficaçment bibliografia i recursos electrònics per obtenir informació

## Resultats d'aprenentatge

1. Desenvolupar un pensament i un raonament crític i saber comunicar-ho de manera efectiva, tant en les llengües pròpies com en una tercera llengua
2. Llegir textos especialitzats d'economia, tant en llengua anglesa com en la llengua pròpia
3. Que els estudiants hagin desenvolupat les habilitats d'aprenentatge necessàries per a emprendre estudis posteriors amb un alt grau d'autonomia.
4. Que els estudiants puguin transmetre informació idees, problemes i solucions a un públic tan especialitzat com no especialitzat
5. Que els estudiants sàpiguen aplicar els seus coneixements al seu treball o vocació d'una forma professional i posseeixin les competències que solen demostrar-se per mitjà de l'elaboració i defensa d'arguments i la resolució de problemes dins de la seva àrea d'estudi.
6. Que els estudiants tinguin la capacitat de reunir i interpretar dades rellevants (normalment dins de la seva àrea d'estudi) per emetre judicis que incloguin una reflexió sobre temes rellevants d'índole social, científica o ètica.
7. Saber aplicar la teoria als problemes i situacions concretes treballats en les classes pràctiques.
8. Saber resoldre problemes de matemàtica financera i d'altres aspectes relacionats amb les activitats d'una empresa o indústria.
9. Trobar models de la realitat d'una empresa o indústria relatius a la seva activitat financera o productiva utilitzant el llenguatge matemàtic.
10. Utilitzar eficaçment bibliografia i recursos electrònics per obtenir informació.

## Continguts

- Introducció
  - Introducció als mercats financers
  - Preu just, valor raonable i finances
  - Acadèmia vs Indústria: Advertiment

## Activitats formatives i Metodologia

Títol	Hores	ECTS	Resultats d'aprenentatge
Tipus: Dirigides			
Classes Pràctiques	20	0,8	1, 10, 9, 7, 8, 2, 5, 6, 4, 3

Classes Teoria	30	1,2	1, 10, 9, 7, 8, 2, 5, 6, 4, 3
Tipus: Supervisades			
Tutories	25	1	1, 10, 9, 7, 8, 2, 5, 6, 4, 3
Tipus: Autònomes			
Estudi + Treball Problemes & Pràctiques	67,5	2,7	1, 10, 9, 7, 8, 2, 5, 6, 4, 3

L'alumne adquireix els coneixements científic-tècnics propis de la assignatura assistint a les classes de teoria i complementant-les amb l'estudi personal dels temes explicats. Les classes de teoria són les activitats en les quals s'exigeix menys interactivitat a l'estudiant: estan concebudes com un mètode fonamentalment unidireccional de transmissió de coneixements del professor a l'alumne.

Els problemes i les pràctiques són sessions amb un nombre reduït d'alumnes amb una doble missió. D'una banda es treballen els coneixements científic-tècnics exposats en les classes de teoria per a completar la seva comprensió i aprofundir en ells desenvolupant activitats diverses, des de la típica resolució de problemes fins la discussió de casos pràctics. D'altra banda, les classes de problemes són el fòrum natural en el qual discutir en comú el desenvolupament del treball pràctic, aportant els coneixements necessaris per a portar-lo endavant, o indicant on i com es poden adquirir. El curs pràctic d'aquesta assignatura es planteja com un camí per orientar l'estudiant en un treball de camp d'estadística en cadascuna de les seves etapes.

Aquest plantejament està orientat a promoure un aprenentatge actiu i a desenvolupar el raonament crític i la capacitat d'anàlisi i síntesi.

La metodologia docent proposada pot experimentar alguna modificació en funció de les restriccions a la presencialitat que imposin les autoritats sanitàries.

Nota: es reservaran 15 minuts d'una classe, dins del calendari establert pel centre/titulació, per a la complementació per part de l'alumnat de les enquestes d'avaluació de l'actuació del professorat i d'avaluació de l'assignatura/mòdul.

Nota: es reservaran 15 minuts d'una classe, dins del calendari establert pel centre/titulació, per a la complementació per part de l'alumnat de les enquestes d'avaluació de l'actuació del professorat i d'avaluació de l'assignatura/mòdul.

## Avaluació

### Activitats d'avaluació continuada

Títol	Pes	Hores	ECTS	Resultats d'aprenentatge
Exàmen	30%	2,5	0,1	1, 10, 9, 7, 8, 2, 5, 6, 4, 3
Problemes	35%	2,5	0,1	1, 10, 9, 7, 8, 2, 5, 6, 4, 3
Pràctiques	35%	2,5	0,1	1, 10, 9, 7, 8, 2, 5, 6, 4, 3

Per tal d'aprovar l'assignatura és necessari que la mitjana de les pràctiques i problemes sigui més gran o igual a 4. Si l'estudiant es presenta a l'examen de recuperació, la nota final serà el màxim entre la nota del curs i la mitja ponderada d'aquesta (30%) i la nota de l'examen de recuperació (70%).

En cas que l'alumne opti per l'Avaluació Única, aquesta constarà d'un Exàmen (50%) i un treball pràctic (50%), per tal de poder superar l'assignatura en aquesta modalitat cal superar una nota mínima de 5 en cada una de les activitats.

L'avaluació proposada pot experimentar alguna modificació en funció de les restriccions a la presencialitat que imposin les autoritats sanitàries.

## Bibliografia

Hull, J. (2008) Options, Futures, and Other Derivatives, Prentice Hall.

## Programari

Excel

## Llista d'idiomes

Nom	Grup	Idioma	Semestre	Torn
(SEM) Seminaris	1	Català	segon quadrimestre	tarda
(TE) Teoria	1	Català	segon quadrimestre	tarda