

**FITXA IDENTIFICATIVA****DADES DE L'ASSIGNATURA**

Codi: 42210
Nom: Derivats (ampliació)
Cicle: Màster Universitari Oficial
Crèdits ECTS: 6
Curs acadèmic: 2026-27

TITULACIONS

Titulació	Centre	Curs	Període
2081 - Màster Universitari en Banca i Finances Quantitatives	Facultat d'Economia	2	Anual

MATÈRIES

Titulació	Matèria	Caràcter
2081 - Màster Universitari en Banca i Finances Quantitatives	Matèries optatives	OPTATIVA

COORDINACIÓ

CARCHANO ALCINA OSCAR

RESUM**CONEIXEMENTS PREVIS****RELACIÓ AMB ALTRES ASSIGNATURES DE LA MATEIXA TITULACIÓ**

No s'ha especificat restriccions de matrícula amb altres assignatures del pla d'estudis.

ALTRES TIPUS DE REQUISITS**COMPETÈNCIES / RESULTATS D' APRENENTATGE****DESCRIPCIÓ DE CONTINGUTS**

1.



2.

3.

4.

5.

6.

7.

8.

9.

VOLUM DE TREBALL (HORES)

ACTIVITATS PRESENCIALS

Activitat	Hores
Teoria	30,00
Pràctiques a l'aula	15,00
Aula informàtica	15,00
Total hores	60,00

ACTIVITATS NO PRESENCIALS

Activitat	Hores
-----------	-------



Assistència a altres activitats	0,00
Elaboració de treballs individuals o en grup	0,00
Estudi i treball autònom	0,00
Preparació de classes	0,00
Preparació d'activitats d'avaluació	0,00
Resolució de casos pràctics	0,00
Total hores	0,00

METODOLOGIA DOCENT

AVALUACIÓ

BIBLIOGRAFIA

- Black, F. and M. Scholes (1973). The Pricing of Options and Corporate Liabilities. *Journal of Political Economy*, 81, 3, 637-654. - Hull, J. (2017). *Options, Futures and other Derivatives*, Prentice Hall, 11th edition. - Kemna, A.G.Z. and Vorst, A.C.F. (1990). A Pricing Method for Options Based on Average Asset Values. *Journal of Banking and Finance*, 14, 113-129. - León-Pérez, B., and M. Moreno (2024). Fixed-Income Average Options: A Pricing Approach Based on Gaussian Mean-reverting Cyclical Models, *Annals of Operations Research*, disponible en <https://doi.org/10.1007/s10479-024-05904-x>. - Moreno, M. and J.F. Navas (2008). Australian Options. *Australian Journal of Management*, 33, 1, 69-93. - Moreno, M., A. Novales, and F. Platania (2017). A Term Structure Model under Cyclical Fluctuations in Interest Rates, *Economic Modelling*, 72, 140-150. - ----- (2019). Long-Term Swings and Seasonality in Energy Markets. *European Journal of Operational Research*, 279, 3, 1011-1023.
- Business cases 1. Speculation in the Financial Futures Market: A Local Tries to Break the Bund (London Metropolitan University 299-009-1). 2. Metallgesellschaft AG (IMD 3-0613). 3. The Collapse of Barings (London Business School 401-020-1). 4. The Collapse of Barings (London Business School 401-021-1). 5. Pine Street Capital (HBS 9-201-071). 6. American Barrick Resource Corporation: Managing Gold Price Risk (HBS 9-293-128)