



Guía Docente				
Datos Identificativos				2015/16
Asignatura (*)	Software profesional nas finanzas	Código	614855218	
Titulación	Mestrado Universitario en Matemática Industrial (2013)			
Descriptorios				
Ciclo	Período	Curso	Tipo	Créditos
Mestrado Oficial	2º cuatrimestre	Primeiro	Optativa	6
Idioma	Castelán			
Modalidade docente	Presencial			
Prerrequisitos				
Departamento	Matemáticas			
Coordinación	Vazquez Cendon, Carlos	Correo electrónico	carlos.vazquez.cendon@udc.es	
Profesorado	Vazquez Cendon, Carlos	Correo electrónico	carlos.vazquez.cendon@udc.es	
Web	www.m2i.es			
Descrición xeral	Preténdese que o alumno coñeza as ferramentas de software máis empregadas en relación cos contidos estudados na asignatura de modelos, así como que sexa capaz de elaborar software propio.			

Competencias / Resultados do título	
Código	Competencias / Resultados do título
A1	Alcanzar un coñecemento básico en un área de Ingeniería/Ciencias Aplicadas, como punto de partida para un adecuado modelado matemático, tanto en contextos bien establecidos como en entornos novos o pouco coñecidos dentro de contextos máis amplos y multidisciplinares.
A2	Modelar ingredientes específicos y realizar las simplificacións adecuadas en el modelo que faciliten su tratamento numérico, manteniendo el grado de precisión, de acuerdo con requisitos previamente establecidos.
A4	Ser capaz de seleccionar un conxunto de técnicas numéricas, linguaxes y ferramentas informáticas, adecuadas para resolver un modelo matemático.
A5	Ser capaz de validar e interpretar los resultados obtenidos, comparando con visualizacións, medidas experimentales y/o requisitos funcionales del correspondiente sistema físico/de ingeniería.
A8	Saber adaptar, modificar e implementar ferramentas de software de simulación numérica.
A9	Conocer, saber seleccionar y saber manejar las herramientas de software profesional (tanto comercial como libre) máis adecuadas para la simulación de procesos en el sector industrial y empresarial.
B1	Saber aplicar los coñecimientos adquiridos y su capacidade de resolución de problemas en entornos novos o pouco coñecidos dentro de contextos máis amplos, incluíndo la capacidade de integrarse en equipos multidisciplinares de I+D+i en el entorno empresarial.
B2	Poseer coñecimientos que aporten una base u oportunidade de ser orixinais en el desarrollo y/o aplicación de ideas, a menudo en un contexto de investigación, sabiendo traducir necesidades industriales en términos de proyectos de I+D+i en el campo de la Matemática Industrial
B3	Ser capaz de integrar coñecimientos para enfrentarse a la formulación de juicios a partir de información que, aun siendo incompleta o limitada, incluya reflexións sobre las responsabilidades sociais y éticas vinculadas a la aplicación de sus coñecimientos.
B4	Saber comunicar las conclusiones, junto con los coñecimientos y razones últimas que las sustentan, a públicos especializados y no especializados de un modo claro y sin ambigüedades.
B5	Poseer las habilidades de aprendizaje que les permitan continuar estudiando de un modo que habrá de ser en gran medida autodirigido o autónomo, y poder emprender con éxito estudos de doctorado.

Resultados da aprendizaxe			
Resultados de aprendizaxe			Competencias / Resultados do título
Ter unha visión panorámica da oferta de software financeiro existente no mercado			AM4 AM8
			BM1 BI1



Saber manexarse con Excel para utilizalo con soltura na resolución eficiente dalgúns problemas financeiros estudados na materia de modelos.	AM1 AM4 AM5 AM8 AM9	BM1 BM2 BI1
Coñecer algunhas ferramentas específicas de Matlab para a valoración de produtos e situacións financeiras	AM2 AM4 AM8 AM9	BM1 BM2 BM3 BI1
Ser capaz de elaborar software financeiro orixinal no ámbito de programación Matlab, utilizando se é necesario os toolboxes de finanzas.	AM4 AM5 AM8 AM9	BP1 BM1 BM2 BM3 BI1
Ser capaz de elaborar software financeiro que requira a interacción entre Matlab e Excel, utilizando ademais a ferramenta Excellink.	AM4 AM5 AM8 AM9	BP1 BM1 BM2 BM3 BI1

Contidos	
Temas	Subtemas
1. Unha panorámica das ferramentas de software profesional en finanzas	
2. Introducción a Excel orientado á súa utilización en finanzas	
3. Ferramentas específicas de Matlab en finanzas	
4. Interacción Excel - VBA - Matlab: Excel Link	
5. Elaboración de software de valoración financeira en Excel e Matlab	
6. Implementación en Excel do cálculo de riscos de mercado e contraparte dunha carteira de produtos financeiros	

Planificación				
Metodoloxías / probas	Competencias / Resultados	Horas lectivas (presenciais e virtuais)	Horas traballo autónomo	Horas totais
Solución de problemas	A4 A5 A9 A8 B2 B5 B3	0	22	22
Sesión maxistral	A1 A2 A4 A5 A9 A8 B2 B5 B1 B4	21	0	21
Traballos tutelados	A4 A5 A9 A8 B5 B3	0	30	30
Solución de problemas	A4 A5 A9 A8 B2 B5 B3	4	4	8
Prácticas a través de TIC	A9 A8 B4	21	42	63
Atención personalizada		6	0	6

*Os datos que aparecen na táboa de planificación son de carácter orientativo, considerando a heteroxeneidade do alumnado

Metodoloxías	
Metodoloxías	Descrición



Solución de problemas	O alumno deberá resolver algunhas das cuestións e problemas que permiten practicar o uso das ferramentas de software
Sesión maxistral	Describirse a utilización das ferramentas de software (Excell, Matlab, etc) para a resolución de modelos e problemas financeiros, algúns deles estudados na materia de modelos matemáticos en finanzas
Traballos tutelados	Encargaranse traballos ou proxectos que consisten en resolver problemas financeiros utilizando as distintas ferramentas de software que se explicaron
Solución de problemas	Formularanse problemas de valoración financeira mediante as ferramentas de software explicadas para a súa resolución presencial
Prácticas a través de TIC	Se resolverán exemplos con axuda do ordenador e practicaranse os comandos das distintas ferramentas de software con exemplos financeiros

Atención personalizada

Metodoloxías	Descrición
Prácticas a través de TIC Solución de problemas	Ademais das consultas en clase, atenderanse de modo personalizado as dúbidas que os alumnos formulen por correo electrónico ou en horas de tutoría previamente concertadas.

Avaliación

Metodoloxías	Competencias / Resultados	Descrición	Cualificación
Traballos tutelados	A4 A5 A9 A8 B5 B3	Encargaranse traballos ou proxectos que consisten en resolver problemas financeiros utilizando as distintas ferramentas de software que se explicaron	75
Solución de problemas	A4 A5 A9 A8 B2 B5 B3	Se formularán problemas de valoración financeira mediante as ferraamientas de software explicadas para a súa resolución presencial	25

Observacións avaliación

--

Fontes de información

Bibliografía básica	<ul style="list-style-type: none"> - The Math Works Inc. (2005). Financial Derivatives Toolbox User?s Guide . - The Math Works Inc. (2005). Financial Toolbox User?s Guide. - (). www.mathworks.com.
Bibliografía complementaria	

Recomendacións

Materias que se recomenda ter cursado previamente

Métodos numéricos e programación/614855201
Modelos matemáticos nas finanzas/614855211
Métodos numéricos estocásticos/614855226

Materias que se recomenda cursar simultaneamente

Materias que continúan o temario

Observacións

--

(*A Guía docente é o documento onde se visualiza a proposta académica da UDC. Este documento é público e non se pode modificar, salvo casos excepcionais baixo a revisión do órgano competente dacordo coa normativa vixente que establece o proceso de elaboración de guías

