

# Futuros y opciones

Códigos: 3007292 - 3010525

Grupo: 1

Créditos: 3

01-2024

Profesor: Miguel Jiménez  
lumjimenezgo@unal.edu.co

# Metodología

## **Material del curso:**

<https://migueljimenezg.github.io/cursos/>

## **Plataforma:**

- **Moodle:** evaluaciones

# Metodología

## **Exámenes:**

- Se realizarán en el Moodle en el horario de clase.
- Preguntas de selección múltiple con única respuesta.
- Son individuales.
- No se califica el procedimiento.

## **Supletorios:**

- Deben ser debidamente justificados.
- Preguntas de selección múltiple con única respuesta.
- Son individuales.
- Sí se califica el procedimiento.
- Todas las preguntas deben tener el procedimiento correcto.
- El procedimiento se envía al finalizar el examen supletorio.

# Temas y evaluaciones

Semana	Fecha	Temas
1	6-8 febrero	Presentación del curso, introducción a los derivados financieros y Forward
2	13-15 febrero	Determinación del precio Forward y valoración de Forward
3	20-22 febrero	Swap IRS
4	27-29 febrero	Swap CCS
5	5-7 marzo	Primer examen – 30% (Forward y Swap) - Jueves
6	12-14 marzo	Introducción a los Futuros
7	19-21 marzo	Operaciones con Futuros
8	26-28 marzo	Semana universitaria
9	2-4 abril	Coberturas
10	9-11 abril	Coberturas para portafolios de inversión
11	16-18 abril	Segundo examen – 30% (Futuros) - Jueves
12	23-25 abril	Introducción a los Opciones Financieras
13	30 abril – 2 mayo	Valoración de Opciones por Simulación Monte Carlo
14	7-9 mayo	Estrategias con Opciones
15	14-16 mayo	Tercer examen – 10% (Opciones) y Trabajo 10% - Jueves
16	21-23 mayo	Árboles Binomiales, Black-Scholes
17	28-30 mayo	Examen Final – 20% (Todo Opciones) - Martes

# Bibliografía

Introducción a los mercados de futuros y opciones.

John C. Hull.

Editorial: Pearson.

Octava edición.

Cartilla AMV:

Guía de estudio examen de certificación de derivados.

