

OBJETIVO GENERAL:

Proporcionar al alumno los conceptos teóricos y analíticos en la investigación de la economía financiera, con énfasis en su relación con la microeconomía y la optimización en tiempo continuo.

CONTENIDO

1. Toma de decisiones en condición de riesgo e incertidumbre
2. Selección óptima de portafolios (Markowitz revisado y Black-Litterman)
3. No arbitraje y precio de Estado
4. Equilibrios en mercados completos
5. Optimización dinámica estocástica
6. Modelos macro con sector financiero
7. Racionalidad de intermediarios financieros

BIBLIOGRAFÍA

Alexander, C. (2009). Market Risk Analysis (Four Volume Boxset edition), John Wiley and Sons.

Cuthbertson, K. y D. Nitzsche (2004). "Quantitative Financial Economics". 2da. Edición. John Wiley and Sons.

Huang, C. y R. Litzenberger (1988). "Foundations for Financial Economics". Prentice Hall.

LeRoy, S. y Jan Werner (2001). "Principles of Financial Economics". Cambridge University Press.

Luenbeger, D. (2013). "Investment science". Oxford University Press.

Panjer, H. y P. Boyle (1998). " Financial economics: with applications to investments, insurance and pensions.

Venegas, M. F. (2008). Riesgos financieros y económicos, productos derivados y decisiones económicas bajo incertidumbre. 2ª Edición. Cengage.

INSTRUMENTOS DE EVALUACIÓN

El curso se evalúa en función de la aplicación de dos exámenes parciales con un valor de 35%, cada Uno. Un trabajo final con un valor de 30%, en el cual se realizará aplicando alguno(s) de los conceptos revisados durante el curso.