

Clase magistral

Profesor: Pamela Cardoza

Horario: Martes de 7:00 a 8:50

Salón: LL_204

Atención a estudiantes: Viernes 7:00 – 8:00 a.m.

1. Objetivos de la materia

Desarrollar habilidades computacionales que incrementarán las capacidades del estudiante para resolver modelos económicos y financieros. Los modelos se formularán de una forma computacional y se utilizarán técnicas de análisis numérico para resolverlos.

2. Contenido

I : Introducción.

1.1 Cómo programar y comandos básicos de Matlab y Visual Basic

- Nagler, Jonathan. **Coding Style and Good Computing Practices**. American Political Science Association.
- (*) **M&F**. Capítulo 1 y Apéndice B.

II : Temas Computacionales

2.1 Ecuaciones lineales

- (*) **M&F**. Capítulo 2

2.2 Ecuaciones no lineales

- (*) **M&F**. Capítulo 3

2.3 Optimización

- (*) **M&F**. Capítulo 4

2.4 Diferenciación e integración numérica

- (*) **M&F**. Capítulo 5

III: Aplicaciones

3.1 Estimación curva cero cupón en Excel

3.2 Estimación forward break-even

3.3 Estimación de Black-Litterman

3. Metodología

La metodología son clases en computadores y talleres. Programar se aprende programando.

4. Competencias

Se espera que al finalizar el curso, los estudiantes sepan programar (en Matlab y Visual Basic) para resolver problemas financieros y económicos.

5. Criterios de evaluación

- Primer Parcial (20%)
- Segundo Parcial (20%)
- Tareas (20%)
- Proyectos (40%)

6. Sistema de aproximación de notas definitiva

- De 0 a 1,74999 la nota definitiva será 1,5
- De 1,75 a 2,24999 la nota definitiva será 2
- De 2,25 a 2,74999 la nota definitiva será 2,5
- De 2,75 a 3,24999 la nota definitiva será 3,0
- De 3,25 a 3,74999 la nota definitiva será 3,5
- De 3,75 a 4,24999 la nota definitiva será 4,0
- De 4,25 a 4,74999 la nota definitiva será 4,5
- De 4,75 a 5,0 la nota definitiva será 5,0

7. Bibliografía

- Miranda, M & Fackler, P. **Applied Computational Economics and Finance**. The MIT Press. **(M&F)**
- Nagler, Jonathan. **Coding Style and Good Computing Practices**. American Political Science Association.
- Nelson, R & Siegel, A. **Parsimonious Modeling of Yield Curves**. The Journal of Business.
- Cedric, Scholtes. **On market-based measures of inflation expectations**. Bank of England Quarterly Bulletin, Spring 2002. Available at SSRN: <http://ssrn.com/abstract=708146>
- Idzorek, Thomas M. **A Step-by-step Guide to the Black-Litterman Model** (2004).

Fecha de entrega del 30% de las notas: Sep. 28

Último día para solicitar retiros parciales de materias y retiros totales de la Universidad (no genera devolución): Oct. 05