

**FITXA IDENTIFICATIVA****DADES DE L'ASSIGNATURA****Codi:** 42200**Nom:** Fonaments d'economia financera I**Cicle:** Màster Universitari Oficial**Crèdits ECTS:** 6**Curs acadèmic:** 2025-26**TITULACIONS**

Titulació	Centre	Curs	Període
2081 - Màster Universitari en Banca i Finances Quantitatives	Facultat d'Economia	1	Anual

MATÈRIES

Titulació	Matèria	Caràcter
2081 - Màster Universitari en Banca i Finances Quantitatives	Matèries obligatòries	OBLIGATÒRIA

COORDINACIÓ

SORIANO FELIPE PILAR

CRUZ GARCIA PAULA

RESUM

Es presenten els fonaments dels models de valoració d'actius financers, tant de renda fixa com de renda variable.

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

Relació amb altres assignatures de la mateixa titulació:

Aquest curs obligatori s'imparteix en el primer trimestre del primer curs.

Els requisits bàsics per a l'aprofitament apropiat del curs són els continguts mínims d'Estadística i Economia, tot i que es pretén sigui assolible per estudiants de llicenciatures diverses. Aquesta assignatura



es complementa amb Fonaments d'Economia Financera II i Valoració d'Actius en el segon any, de caràcter optatiu, i especialment dissenyat per als estudiants interessa

COMPETÈNCIES / RESULTATS D' APRENENTATGE

DESCRIPCIÓ DE CONTINGUTS

1. Tema 1. Valoració d'actius en un context d'absència d'arbitratge
2. Tema 2. L'equació fonamental de valoració i les seves aplicacions
3. Tema 3. L'anàlisi de mitjana-variància de les carteres
4. Tema 4. La cartera òptima de l'inversor
5. Tema 5. El model de valoració d'actius financers amb cartera de mercat: El CAPM
6. Tema 6. El model de valoració d'actius financers sota absència d'arbitratge: El APT

VOLUM DE TREBALL (HORES)

ACTIVITATS PRESENCIALS

Activitat	Hores
Teoria	30,00
Aula informàtica	30,00
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

Classe magistral i pràctiques de resolució d'exercicis numèrics.

AVALUACIÓ

L'avaluació es componrà d'un examen final i de la valoració d'exercicis i tasques de resolució individuals que s'aniran presentant al llarg del curs.

BIBLIOGRAFIA

- "Economía Financiera", J. Marín y G. Rubio, Ed. Antoni Bosch, 2001. - Ejercicios de Economía Financiera, Miguel Angel Martínez, Ed. Antoni Bosch, 2005. - "Modern Portfolio Theory and Investment Analysis", Elton E. J., M.J. Gruber, S. J. Brown y W.J. Goetzmann, Ed. Wiley, 2003. - "Econometrics of Financial Markets", Campbell J.Y., A. W. Lo y C. A. MacKinlay, 1997 Princeton University Press, 1997.