

**FITXA IDENTIFICATIVA****DADES DE L'ASSIGNATURA****Codi:** 42200**Nom:** Fonaments d'economia financera I**Cicle:** Màster Universitari Oficial**Crèdits ECTS:** 6**Curs acadèmic:** 2026-27**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.

p&gt;

**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
<b>Total hores</b>	<b>60,00</b>

### 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
<b>Total hores</b>	<b>0,00</b>

## METODOLOGIA DOCENT

Classe magistral i pràctiques de resolució d'exercicis numèrics.

s.

## AVALUACIÓ

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

urs.

## 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.