

**FICHA IDENTIFICATIVA****DATOS DE LA ASIGNATURA**

Código: 42206
Nombre: Modelos de renta fija
Ciclo: Máster Universitario Oficial
Créditos ECTS: 4
Curso académico: 2025-26

TITULACIONES

Titulación	Centro	Curso	Periodo
2081 - Máster Universitario en Banca y Finanzas Cuantitativas	Facultat d'Economia	1	Anual

MATERIAS

Titulación	Materia	Carácter
2081 - Máster Universitario en Banca y Finanzas Cuantitativas	Materias obligatorias	OBLIGATORIA

COORDINACIÓN

TORRO I ENGUIX HIPOLIT

RESUMEN

Tiene como objetivo general el estudio de los activos y mercados de renta fija. En concreto se plantean los siguientes objetivos particulares:

- Analizar y construir estructuras temporales de los tipos de interés
- Implicaciones económicas de la estructura temporal de los tipos de interés
- Metodologías de valoración de activos de renta fija
- Derivados de renta fija
- Metodologías de valoración de derivados de renta fija
- Riesgo de Interés



- Gestión de riesgos

CONOCIMIENTOS PREVIOS

RELACIÓN CON OTRAS ASIGNATURAS DE LA MISMA TITULACIÓN

No se han especificado restricciones de matrícula con otras asignaturas del plan de estudios.

OTROS TIPOS DE REQUISITOS

Relación con otras asignaturas de la misma titulación:

La asignatura se imparte en el tercer trimestre del curso académico. En ese momento, el alumno ya debe de haber adquirido, de acuerdo a la secuencia prevista de los cursos, el conocimiento de base necesario en materia de Derivados, Procesos Estocásticos, Econometría y Economía financiera para poder desarrollar la asignatura de Modelos de Renta Fija con unos pilares sólidos de conocimiento de los mercados de activos financieros y activos derivados en

COMPETENCIAS / RESULTADOS DE APRENDIZAJE

DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS

1. Tema 1. Introducción: el concepto de interés.
2. Tema 2. Estimación de la estructura temporal de los tipos de interés
3. Tema 3. Interpretación de la estructura temporal de los tipos de interés.
4. Tema 4. Riesgo de interés.
5. Tema 5. Introducción a los derivados sobre tipos de interés.



6. Tema 6. Valoración Binomial

7. Tema 7. El modelo estándar de mercado

8. Tema 8. Modelos unifactoriales en tiempo continuo.

VOLUMEN DE TRABAJO (HORAS)

ACTIVIDADES PRESENCIALES

Actividad	Horas
Teoría	20,00
Prácticas en aula	10,00
Aula informática	10,00
Total horas	40,00

ACTIVIDADES NO PRESENCIALES

Actividad	Horas
Asistencia a otras actividades	0,00
Elaboración de trabajos individuales o en grupo	0,00
Estudio y trabajo autónomo	0,00
Preparación de clases	0,00
Preparación de actividades de evaluación	0,00
Resolución de casos prácticos	0,00
Total horas	0,00

METODOLOGÍA DOCENTE

Clase magistral, prácticas en aula y prácticas con ordenador.

EVALUACIÓN

La evaluación final se realizará con un examen final sobre los contenidos desarrollados en el curso. Complementariamente, se valorará la realización de trabajos y exposiciones por parte de los alumnos

BIBLIOGRAFÍA



- Material de clase en forma de transparencias y notas - Hull, J. C. (2006) Options, futures, and other Derivatives, Sixth Edition, Prentice Hall, caps. 6, 7, 26 & 28. - Jarrow, R., & Turnbull, S. (1996) Derivatives Securities, South-Western College Publishing, cap. 15. - Navarro, E., y Nave, J.M. (2001) Fundamentos de Matemáticas Financieras, Ed. Antoni Bosch, cap. 7. - Pliska, S. R. (1997) Introduction to Mathematical Finance : Discrete Time Models, Blackwell, cap. 6. - Nielsen, L. T. (1999) Pricing and Hedging of Derivatives Securities, Oxford University Press, cap. 7. - Baxter M., & Rennie, A. (1996) Financial Calculus, Cambridge University Press, cap 6.4.