



FITXA IDENTIFICATIVA

DADES DE L'ASSIGNATURA

Codi: 42206

Nom: Models de renda fixa

Cicle: Màster Universitari Oficial

Crèdits ECTS: 4

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

TORRO I ENGUIX HIPOLIT

RESUM

Té com a objectiu general l'estudi dels actius i mercats de renda fixa. En concret es plantegen els següents objectius particulars:

- Analitzar i construir estructures temporals dels tipus d'interès
- Implicacions econòmiques de l'estructura temporal dels tipus d'interès
- Metodologies de valoració d'actius de renda fixa
- Derivats de renda fixa
- Metodologies de valoració de derivats de renda fixa
- Risc d'Interès
- Gestió de riscos

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:

L'assignatura s'imparteix en el tercer trimestre del curs acadèmic. En aquest moment, l'alumne ja deu haver adquirit, d'acord a la seqüència prevista dels cursos, el coneixement de base necessari en matèria de Derivats, Processos Estocàstics, Econometria i Economia financera per poder desenvolupar l'assignatura de Models de Renda Fixa amb uns pilars sòlids de coneixement dels mercats d'actius financers i actius derivats en particular, les seves metod

COMPETÈNCIES / RESULTATS D' APRENTATGE

DESCRIPCIÓ DE CONTINGUTS

- 1. Tema 1. Introducció: el concepte d'interès**
- 2. Tema 2. Estimació de l'estructura temporal dels tipus d'interès.**
- 3. Tema 3. Interpretació de l'estructura temporal dels tipus d'interès.**
- 4. Tema 4. Risc d'interès**
- 5. Tema 5. Introducció als derivats sobre tipus d'interès.**
- 6. Tema 6. Valoració Binomial**
- 7. Tema 7. Risc d'interès.**
- 8. Tema 8. Models unifactorials en temps continu**

**VOLUM DE TREBALL (HORES)****ACTIVITATS PRESENCIALS**

Activitat	Hores
Teoria	20,00
Pràctiques a l'aula	10,00
Aula informàtica	10,00
Total hores	40,00

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, pràctiques en aula i pràctiques amb ordinador.

AVALUACIÓ

L'avaluació final es realitzarà amb un examen final sobre els continguts desenvolupats en el curs. Complementàriament, es valorarà la realització de treballs i exposicions per part dels alumnes.

BIBLIOGRAFIA

- Material de classe en forma de transparencies 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.