

**FITXA IDENTIFICATIVA****DADES DE L'ASSIGNATURA**

Codi: 42206
Nom: Models de renda fixa
Cicle: Màster Universitari Oficial
Crèdits ECTS: 4
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

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

e; 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.

umnes.

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.