

**FITXA IDENTIFICATIVA****Dades de l'Assignatura**

Codi	42200
Nom	Fonaments d'economia financera I
Cicle	Màster
Crèdits ECTS	6.0
Curs acadèmic	2023 - 2024

Titulació/titulacions

Titulació	Centre	Curs	Període
2081 - M.U. en Banca i Finances Quantitatives 09-V.1	Facultat d'Economia	1	Anual

Matèries

Titulació	Matèria	Caràcter
2081 - M.U. en Banca i Finances Quantitatives 09-V.1	1 - Matèries obligatòries	Obligatòria

Coordinació

Nom	Departament
CRUZ GARCIA, PAULA	10 - Anàlisi Econòmica
SORIANO FELIPE, PILAR	113 - Economia Financera i Actuarial

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 heu especificat les 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 DE L'APRENTATGE

Conèixer els fonaments dels models de valoració d'actius financers, tant de renda fixa com de renda variable. Amb un enfocament eminentment teòric, basat en la utilització de la condició d'absència d'arbitratge, s'aprèn a analitzar les principals conclusions que poden derivar-se d'aquest simple supòsit

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

ACTIVITAT	Hores	% Presencial
Classes de teoria	60,00	100
TOTAL	60,00	

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.

REFERÈNCIES

Bàsiques

- "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.