

**COURSE DATA****Data Subject**

Code	42206
Name	Fixed interest models
Cycle	Master's degree
ECTS Credits	4.0
Academic year	2023 - 2024

Study (s)

Degree	Center	Acad. year	Period
2081 - M.U. Banca y Finanzas Cuantitativas (2007)	Faculty of Economics	1	Annual

Subject-matter

Degree	Subject-matter	Character
2081 - M.U. Banca y Finanzas Cuantitativas (2007)	1 - Compulsory subjects	Obligatory

Coordination

Name	Department
TORRO I ENGUIX, HIPOLIT	113 - Financial and Actuarial Economics

SUMMARY**English version is not available**

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

PREVIOUS KNOWLEDGE

Relationship to other subjects of the same degree

There are no specified enrollment restrictions with other subjects of the curriculum.

Other requirements

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

OUTCOMES

LEARNING OUTCOMES

English version is not available

WORKLOAD

ACTIVITY	Hours	% To be attended
Theory classes	40,00	100
TOTAL	40,00	

TEACHING METHODOLOGY

English version is not available



EVALUATION

English version is not available

REFERENCES

Basic

- 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.