

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

Codi	35856
Nom	Tècniques quantitatives en finances
Cicle	Grau
Crèdits ECTS	4.5
Curs acadèmic	2023 - 2024

Titulació/titulacions

Titulació	Centre	Curs	Període
1313 - Grau d'Administració i Direcció d'Empreses	Facultat d'Economia	4	Primer quadrimestre

Matèries

Titulació	Matèria	Caràcter
1313 - Grau d'Administració i Direcció d'Empreses	33 - Técnicas Cuantitativas en Finanzas	Optativa

Coordinació

Nom	Departament
BRETO MARTINEZ, CARLES	10 - Anàlisi Econòmica

RESUM

L'objectiu central de l'assignatura és exposar als estudiants als fonaments i pràctica de tècniques quantitatives adequades per a l'anàlisi de la realitat financera. Els temes principals que s'aborden són les propietats estadístiques de sèries temporals de variables financeres i l'estimació de models a partir de dades reals de cara a la valoració de carteres i a la presa de decisions.

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

Es recomana haver cursat amb aprofitament les matèries de Matemàtiques I i II, Estadística I i II i Econometria.

COMPETÈNCIES

1313 - Grau d'Administració i Direcció d'Empreses

- Capacitat d'anàlisi i síntesi.
- Habilitat per a analitzar i buscar informació provinent de fonts diverses.
- Capacitat per a la resolució de problemes.
- Capacitat de prendre decisions.
- Capacitat crítica i autocrítica.
- Motivació per la qualitat.
- Conèixer i saber utilitzar adequadament els diferents mètodes quantitatius i qualitatius apropiats per raonar analíticament, avaluar resultats i predir magnituds econòmiques i financeres.
- Capacitat per a prendre decisions en ambients de certitud i incertesa.
- Capacitat per a aplicar mètodes analítics i matemàtics per a l'anàlisi dels problemes econòmics i empresarials.
- Capacitat per a definir, resoldre i exposar de forma sistèmica problemes complexos.
- Capacitat per a expressar-se en llenguatges formals, gràfics i simbòlics.

RESULTATS DE L'APRENTATGE

- Realitzar prediccions de variables rellevants en finances utilitzant múltiples tècniques d'anàlisi quantitativa mitjançant programes informàtics, en base a les quals prendre decisions.
- Valorar l'adequació de tècniques d'anàlisi quantitativa en diferents casos.
- Valorar les limitacions de tècniques d'anàlisi quantitativa en diferents casos.

DESCRIPCIÓ DE CONTINGUTS

1. Dades i mercats financers

**2. Propietats estadístiques dels rendiments financers****3. Models ARIMA****4. Anàlisi de la volatilitat. Models ARCH****VOLUM DE TREBALL**

ACTIVITAT	Hores	% Presencial
Classes de teoria	30,00	100
Pràctiques en aula	15,00	100
Estudi i treball autònom	30,00	0
Lectures de material complementari	15,00	0
Preparació de classes de teoria	10,00	0
Preparació de classes pràctiques i de problemes	12,50	0
TOTAL	112,50	

METODOLOGIA DOCENT

La docència s'estructurarà al voltant de classes teòriques i de classes pràctiques. En les classes teòriques, s'exposaran els aspectes centrals de la matèria, motivats a partir dades reals i problemes concrets. Aquestes dades reals i problemes concrets s'abordaran també en les classes pràctiques, en les quals el centre d'atenció estarà en la resolució d'aquests problemes i en l'estudi i anàlisi de les dades d'aquests casos reals.

AVALUACIÓ

Qualificació global de l'assignatura: examen final (70%) + avaluació contínua (30%).

Per a superar l'assignatura, serà necessari haver aprovat l'examen final. L'avaluació contínua es farà al llarg del curs acadèmic i podrà incloure treballs, exercicis, proves parcials i participació en activitats a l'aula.



REFERÈNCIES

Bàsiques

- Wooldridge, J. M. (2015). Introducción a la econometría: un enfoque moderno / Jeffrey M. Wooldridge; traducción Ma. del Carmen Enriqueta Hano Roa, Érika M. Jasso Hernan dBorneville (5a ed). México DF: Cengage Learning.
https://trobes.uv.es/permalink/34CVA_UV/um6gse/alma991001861329706258
- Wooldridge, J. M. (2011). Introducción a la econometría: un enfoque moderno / Jeffrey M. Wooldridge; traducción Ma. del Carmen Enriqueta Hano Roa, Érika M. Jasso Hernan dBorneville (4a ed.). México DF: Cengage Learning.
https://trobes.uv.es/permalink/34CVA_UV/um6gse/alma991006612259706258

Complementàries

- Tsay, R. S. (2010). Analysis of financial time series [electronic resource] / Ruey S. Tsay. (3rd edition). Hoboken, NJ: Wiley.
https://trobes.uv.es/permalink/34CVA_UV/um6gse/alma991009620333106258
- Tsay, R. S. (2010). Analysis of financial time series / Ruey S. Tsay., the University of Chicago Booth School of Business Chicago, IL (Third Edition). Hoboken, New Jersey: Wiley.
https://trobes.uv.es/permalink/34CVA_UV/um6gse/alma991009573315206258