FICHA IDENTIFICATIVA

Datos de la Asignatura

Código	35856
Nombre	Técnicas cuantitativas en Finanzas
Ciclo	Grado
Créditos ECTS	4.5
Curso académico	2024 - 2025

Titulación(es)

Titulación	Centro	Curso	Periodo
1313 - Grado en Administración y Dirección de Empresas	Facultad de Economía	4	Primer cuatrimestre

Materias

Titulación	Materia	Carácter
1313 - Grado en Administración y Dirección de Empresas	33 - Técnicas Cuantitativas en Finanzas	Optativa

Coordinación

Nombre	Departamento
BRETO MARTINEZ, CARLES	10 - Análisis Económico

RESUMEN

El objetivo central de la asignatura es exponer a los estudiantes a los fundamentos y práctica de técnicas cuantitativas adecuadas para el análisis de la realidad financiera. Los temas principales que se abordan son las propiedades estadísticas de series temporales de variables financieras y la estimación de modelos a partir de datos reales de cara a la valoración de carteras y a la toma de decisiones.

CONOCIMIENTOS PREVIOS

Relación con otras asignaturas de la misma titulación

No se han especificado restricciones de matrícula con otras asignaturas del plan de estudios.

Otros tipos de requisitos

Se recomienda haber cursado con aprovechamiento las materias de Matemáticas I y II, Estadística I y II y Econometría.

COMPETENCIAS (RD 1393/2007) // RESULTADOS DEL APRENDIZAJE (RD 822/2021)

1313 - Grado en Administración y Dirección de Empresas

- Capacidad de análisis y síntesis.
- Habilidad para analizar y buscar información proveniente de fuentes diversas.
- Capacidad para la resolución de problemas.
- Capacidad de tomar decisiones.
- Capacidad crítica y autocrítica.
- Motivación por la calidad.
- Conocer y saber utilizar adecuadamente los diferentes métodos cuantitativos y cualitativos apropiados para razonar analíticamente, evaluar resultados y predecir magnitudes económicas y financieras.
- Capacidad para tomar decisiones en ambientes de certidumbre e incertidumbre.
- Capacidad para aplicar métodos analíticos y matemáticos para el análisis de los problemas económicos y empresariales.
- Capacidad para definir, resolver y exponer de forma sistémica problemas complejos.
- Capacidad para expresarse en lenguajes formales, gráficos y simbólicos.

RESULTADOS DE APRENDIZAJE (RD 1393/2007) // SIN CONTENIDO (RD 822/2021)

- Realizar predicciones de variables relevantes en finanzas utilizando múltiples técnicas de análisis cuantitativo mediante programas informáticos, en base a las cuales tomar decisiones.

- Valorar la adecuación de técnicas de análisis cuantitativo en distintos casos.

- Valorar las limitaciones de técnicas de análisis cuantitativo en distintos casos.

DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS

1. Datos y mercados financieros

2. Propiedades estadísticas de los rendimientos financieros

3. Modelos ARIMA

4. Análisis de la volatilidad. Modelos ARCH

VOLUMEN DE TRABAJO

ACTIVIDAD	Horas	% Presencial
Clases de teoría	30,00	100
Prácticas en aula	15,00	100
Estudio y trabajo autónomo	30,00	0
Lecturas de material complementario	15,00	0
Preparación de clases de teoría	10,00	0
Preparación de clases prácticas y de problemas	12,50	0
TOTAL	**112,50**	

METODOLOGÍA DOCENTE

La docencia se estructurará alrededor de clases teóricas y de clases prácticas. En las clases teóricas, se expondrán los aspectos centrales de la materia, motivados a partir de casos reales y problemas concretos. Estos casos reales y problemas concretos se abordarán también en las clases prácticas, en las cuales el foco estará en la resolución de dichos problemas y en el estudio y análisis de los datos de dichos casos reales.

EVALUACIÓN

Calificación global de la asignatura: examen final (70%) + evaluación continua (30%).

Para superar la asignatura, será necesario haber aprobado el examen final. La evaluación continua ser hará a lo largo del curso académico y podrá incluir trabajos, ejercicios, pruebas parciales y participación en actividades en el aula.

REFERENCIAS

Básicas

- 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

Complementarias

- 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