

**FICHA IDENTIFICATIVA****Datos de la Asignatura**

Código	42204
Nombre	Econometría financiera
Ciclo	Máster
Créditos ECTS	6.0
Curso académico	2021 - 2022

Titulación(es)

Titulación	Centro	Curso	Periodo
2081 - M.U. en Banca y Finanzas Cuantitativas 09-V.1	Facultad de Economía	1	Anual

Materias

Titulación	Materia	Caracter
2081 - M.U. en Banca y Finanzas Cuantitativas 09-V.1	1 - Materias obligatorias	Obligatoria

Coordinación

Nombre	Departamento
ARRIBAS FERNANDEZ, IVAN	10 - Análisis Económico

RESUMEN

Se aprende a aplicar distintas técnicas de estimación y contrastes cuantitativos a datos financieros, empleando diferente software, para tomar decisiones óptimas en base a los resultados obtenidos y valorar y analizar carteras.

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

Relación con otras asignaturas de la misma titulación:

Econometría financiera se imparte en el segundo trimestre del primer curso.

Las siguientes dos asignaturas, que se imparten en el primer trimestre, proporcionan conocimientos previos necesarios:

- La asignatura Matemáticas y Estadística introduce los conceptos matemáticos y estadísticos básicos que serán fundamentales en el estudio y análisis cuantitativo de los mercados financieros.
- La asignatura Fundamentos de Economía Financiera I presenta

COMPETENCIAS

RESULTADOS DE APRENDIZAJE

- Capacidad de análisis, razonamiento crítico y síntesis.
- Rigor en el análisis econométrico y financiero.
- Capacidad de trabajo en equipo.
- Destreza en la búsqueda de información y el uso de herramientas informáticas.

DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS

1. Tema 1. Especificación y diagnóstico de modelos de regresión en contexto de datos de sección cruzada y serie temporal

2. Tema 2. Contrastes del modelo de valoración de activos financieros con cartera de mercado, CAPM

**VOLUMEN DE TRABAJO**

ACTIVIDAD	Horas	% Presencial
Clases de teoría	60,00	100
TOTAL	60,00	

METODOLOGÍA DOCENTE

Clase magistral, prácticas en aula y prácticas con ordenador.

EVALUACIÓN

La evaluación constará de tareas individuales y/o en grupo realizadas a lo largo del curso y exposiciones orales. Asimismo, se exigirá superar un examen escrito que ponderará al menos el 70% de la nota final.

REFERENCIAS**Básicas**

- Campbell, J. Y., Lo, A. W. y MacKinlay, A. C. (1997). The Econometrics of Financial Markets. Princeton University Press.
- Davidson, R. y MacKinnon, J. G. (2004). Econometric Theory and Methods. Oxford University Press.
- Greene, W. H. (2008). Econometric Analysis. Prentice Hall, sexta edición.
- Marín, J.M. y Rubio, G. (2001). Economía Financiera. Antoni Bosch, Barcelona.

ADENDA COVID-19

Esta adenda solo se activará si la situación sanitaria lo requiere y previo acuerdo del Consejo de Gobierno

En caso de tener que suspenderse la actividad presencial, el programa se reorganizará para poder continuar online con el desarrollo del Máster, manteniendo la calidad y el rigor tanto de las clases como de los métodos de evaluación. La Comisión Académica valorará la conveniencia de modificar la forma de evaluación de las asignaturas y cualquier posible cambio será anunciado al alumnado a la mayor brevedad posible.