

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

Código	42204
Nombre	Econometría financiera
Ciclo	Máster
Créditos ECTS	6.0
Curso académico	2022 - 2023

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
BRETO MARTINEZ, CARLES	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.