

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

Codi	42204
Nom	Econometria financera
Cicle	Màster
Crèdits ECTS	6.0
Curs acadèmic	2022 - 2023

Titulació/titulacions

Titulació	Centre	Curs	Període
2081 - M.U. en Banca i Finances Quantitatives 09-V.1	Facultat d'Economia	1	Anual

Matèries

Titulació	Matèria	Caràcter
2081 - M.U. en Banca i Finances Quantitatives 09-V.1	1 - Matèries obligatòries	Obligatòria

Coordinació

Nom	Departament
BRETO MARTINEZ, CARLES	10 - Anàlisi Econòmica

RESUM

S'aprèn a aplicar diferents tècniques economètriques d'estimació i contrastos quantitatius a dades financeres, emprant diferent programari, per prendre decisions òptimes en base als resultats obtinguts i valorar i analitzar carteres.

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

Relació amb altres assignatures de la mateixa titulació

Econometria financera s'imparteix en el segon trimestre del primer curs.

Les següents dues assignatures, que s'imparteixen en el primer trimestre, proporcionen coneixements previs necessaris:

- L'assignatura Matemàtiques i Estadística introdueix els conceptes matemàtics i estadístics bàsics que seran fonamentals en l'estudi i anàlisi quantitativa dels mercats financers.
- L'assignatura Fonaments d'Economia Financera I presenta els fonaments del

COMPETÈNCIES

RESULTATS DE L'APRENTATGE

- Capacitat d'anàlisi, raonament crític i síntesi.
- Rigor en l'anàlisi economètrica i financer.
- Capacitat de treball en equip.
- Destresa en la recerca d'informació i l'ús d'eines informàtiques.

DESCRIPCIÓ DE CONTINGUTS

1. Tema 1. Especificació, estimació i diagnòstic de models de regressió en context de dades de secció creuada i sèrie temporal.

2. Tema 2. Contrastos del model de valoració d'actius financers amb cartera de mercat, CAPM



VOLUM DE TREBALL

ACTIVITAT	Hores	% Presencial
Classes de teoria	60,00	100
TOTAL	60,00	

METODOLOGIA DOCENT

Classes magistrals, pràctiques en aula i pràctiques amb ordinador.

AVALUACIÓ

L'avaluació constarà de tasques individuals i / o en grup realitzades al llarg del curs i exposicions orals. Així mateix, es podrà exigir un examen escrit final.

REFERÈNCIES

Bàsiques

- 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 edició.
- Marín, J.M. y Rubio, G. (2001). Economía Financiera. Antoni Bosch, Barcelona.