

**COURSE DATA****Data Subject**

Code	42204
Name	Financial econometrics
Cycle	Master's degree
ECTS Credits	6.0
Academic year	2023 - 2024

Study (s)

Degree	Center	Acad. Period year
2081 - Master's Degree in Banking and Quantitative Finance	Faculty of Economics	1 Annual

Subject-matter

Degree	Subject-matter	Character
2081 - Master's Degree in Banking and Quantitative Finance	1 - Compulsory subjects	Obligatory

Coordination

Name	Department
BRETO MARTINEZ, CARLES	10 - Economic Analysis

SUMMARY**English version is not available**

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.

PREVIOUS KNOWLEDGE**Relationship to other subjects of the same degree**

There are no specified enrollment restrictions with other subjects of the curriculum.

**Other requirements**

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

COMPETENCES (RD 1393/2007) // LEARNING OUTCOMES (RD 822/2021)**LEARNING OUTCOMES (RD 1393/2007) // NO CONTENT (RD 822/2021)**

English version is not available

WORKLOAD

ACTIVITY	Hours	% To be attended
Theory classes	60,00	100
TOTAL	60,00	

TEACHING METHODOLOGY

English version is not available

EVALUATION

English version is not available

REFERENCES**Basic**

- 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.

