

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

Code	42211
Name	Financial econometrics (extension)
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	2 Annual

Subject-matter

Degree	Subject-matter	Character
2081 - Master's Degree in Banking and Quantitative Finance	2 - Optional subjects	Optional

Coordination

Name	Department
TORRO I ENGUIX, HIPOLIT	113 - Financial and Actuarial Economics

SUMMARY**English version is not available**

El objetivo de esta materia es proporcionar a los alumnos conocimientos de los modelos econométricos habitualmente utilizados en la toma de decisiones de finanzas.

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

Los estudiantes deberían haber cursado las asignaturas de Matemáticas y Estadística, Procesos Estocásticos, y Econometría Financiera. Los conocimientos adquiridos y las herramientas desarrolladas son útiles para otras asignaturas obligatorias de la titulación, como Valoración de Activos y Medición de Riesgos, así como para el Seminario en Finanzas.

Otros tipos de requisitos

No se han especificado restricciones de matrícula con otras as

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, A. Lo, y A.C. MacKinlay (1997), The econometrics of financial markets, Princeton University Press
- Hamilton, J. (1999), Time series analysis, Princeton University Press
- Novales, A. (1993), Econometria, Mc Graw-Hill
- Novales, A. (2017), Modelos Vectoriales Autoregresivos, manuscrito
- Novales, A. (2017), Estimación de modelos no lineales, manuscrito

