

27522 - Análisis econométrico

Información del Plan Docente

Año académico: 2023/24

Asignatura: 27522 - Análisis econométrico

Centro académico: 109 - Facultad de Economía y Empresa

Titulación: 449 - Graduado en Finanzas y Contabilidad

Créditos: 6.0

Curso: 3

Periodo de impartición: Primer semestre

Clase de asignatura: Obligatoria

Materia:

1. Información básica de la asignatura

Esta asignatura tiene como objetivo principal que el estudiante se introduzca en el manejo de modelos econométricos de manera que, al finalizar el curso, tenga la soltura necesaria para diseñar y resolver un trabajo de investigación aplicado. La orientación de la asignatura es de tipo práctico. Para ello se utilizarán modelos, casos de estudio y datos reales tomados del ámbito de las finanzas.

Estos planteamientos y objetivos están alineados con los Objetivos de Desarrollo Sostenible (ODS) de la Agenda 2030 de Naciones Unidas (<https://www.un.org/sustainabledevelopment/es/>), en concreto, las actividades previstas en la asignatura contribuirán al logro de los objetivos 4, 5, 8 y 12.

2. Resultados de aprendizaje

Al superar la asignatura se espera que el estudiante sea capaz de:

- Integrar los conocimientos de la teoría económica, los problemas que presentan los datos económicos-financieros y las técnicas adecuadas para su tratamiento.
- Entender los conceptos y objetivos básicos de la econometría financiera y su utilidad en la toma de decisiones.
- Discriminar entre los diferentes tipos de datos más habituales en aplicaciones de análisis económico y financiero.
- Identificar los elementos que intervienen en un modelo econométrico.
- Comprender y valorar la metodología econométrica y distinguir entre sus distintas etapas: especificación, estimación, verificación y explotación.
- Comprender y describir las características específicas que presentan las series económicas financieras y conocer las técnicas específicas para su análisis.
- Conocer y valorar los conceptos de estacionalidad y estacionariedad en un contexto de series temporales.
- Conocer y aplicar la metodología Box-Jenkins para el análisis de series temporales.
- Comprender y modelizar la volatilidad en los mercados financieros.
- Interpretar modelos econométricos.
- Manejar alguno de los instrumentos informáticos más habituales en este campo.

3. Programa de la asignatura

TEMA 1. Econometría y Econometría financiera

- 1.1 Definiciones de Econometría.
- 1.2 Tipos de datos.
- 1.3 Datos financieros y Econometría para las finanzas.
- 1.4 Modelos econométricos.

TEMA 2. El modelo de regresión lineal clásico

- 2.1 Especificación.
- 2.2 Estimación.
- 2.3 Diagnóstico.
- 2.4 Predicción.

TEMA 3. Introducción a los modelos univariantes de series temporales

- 3.1 Enfoque no paramétrico.
- 3.2 Enfoque paramétrico. Modelos ARMA y ARIMA.

TEMA 4. Modelos ARIMA. Enfoque Box-Jenkins

- 4.1 Identificación y estimación.
- 4.2 Diagnóstico.
- 4.3 Predicción.

TEMA 5. Volatilidad y medidas de riesgo

- 5.1 Motivación.
- 5.2 Indicadores de volatilidad. Modelos Value-at-Risk.
- 5.3 Modelización de la volatilidad: modelos ARCH y GARCH.

4. Actividades académicas

La asignatura tiene asignada 150 horas (6 ECTS) distribuidas en:

Clases magistrales: 30 horas

El contenido teórico se presentará en forma de lección magistral participativa.

Clases prácticas: 30 horas

Prácticas de problemas en el aula convencional y prácticas con ordenador en el aula de informática.

Estudio Personal: 84 horas

Pruebas Evaluación: 6 horas

En principio la metodología de impartición de la docencia y su evaluación está previsto que pivote alrededor de clases presenciales. No obstante, si las circunstancias lo requieren, podrán realizarse de forma online.

5. Sistema de evaluación

La asignatura se evaluará por evaluación continua o evaluación global en primera convocatoria y mediante evaluación global durante segunda convocatoria.

Evaluación continua: se compone de dos pruebas: primera prueba con un peso sobre la calificación final del 60% que examinará sobre los contenidos de los Temas 1 a 3; y una segunda prueba sobre los Temas 4 a 5 que tendrá un peso del 40% restante. Cada una de estas pruebas a su vez se dividen en otras dos pruebas: prueba escrita de tipo teórico-práctico y prueba de ordenador. Dado el carácter aplicado de la asignatura, las pruebas de ordenador tendrán una ponderación del 60%.

La primera prueba de evaluación continua se realizará al término del Tema 3. La segunda prueba de evaluación continua se realizará tras finalizar el tema 5. Ambas pruebas se realizarán en horario de clase o en los días específicamente habilitados por el centro para la realización de pruebas de evaluación continua.

El requisito para superar la asignatura por esta vía es obtener un mínimo de 3 sobre 10 en todas las pruebas escritas y de ordenador, así como obtener una calificación promediada según los pesos anteriormente descritos igual o superior a 5 en la nota final en una escala de 0 a 10.

El estudiante que no supere la asignatura por evaluación continua o que quisiera mejorar su nota deberá presentarse a la evaluación global con todo el programa de la asignatura.

Evaluación global: Se compone de dos pruebas: prueba escrita y prueba de ordenador. La prueba de ordenador tendrá una ponderación del 60% y la prueba escrita el 40% restante. Se realizará de acuerdo a las convocatorias oficiales que publique el centro en el calendario de exámenes. El requisito para superar la asignatura por esta vía es obtener un mínimo de 3 tanto en la prueba escrita como en la prueba de ordenador y una calificación igual o superior a 5 en la nota final en una escala de 0 a 10.

Criterios de Evaluación: En todas las pruebas se valorará la propiedad del lenguaje, la precisión y la exhaustividad de las respuestas, así como la capacidad expositiva del estudiante.