

## 61428 - Finanzas cuantitativas

### Información del Plan Docente

**Año académico:** 2023/24

**Asignatura:** 61428 - Finanzas cuantitativas

**Centro académico:** 109 - Facultad de Economía y Empresa

**Titulación:** 526 - Máster Universitario en Contabilidad y Finanzas

**Créditos:** 4.0

**Curso:** 1

**Periodo de impartición:** Anual

**Clase de asignatura:** Optativa

**Materia:**

### 1. Información básica de la asignatura

La asignatura "Finanzas cuantitativas" es instrumental y básica y tiene por objeto proporcionar al estudiantado las herramientas necesarias para el análisis e interpretación de la información financiera, y el conocimiento sobre técnicas cuantitativas necesarias para la modelización del comportamiento de las variables financieras. Mediante la diferenciación entre modelos univariantes y multivariantes se proporciona al estudiantado una metodología de trabajo más robusta y adecuada a cada realidad económica y financiera a analizar.

Estos planteamientos y objetivos están alineados con los Objetivos de Desarrollo Sostenible (ODS) de la agenda 2030 y determinadas metas concretas (<https://www.un.org/sustainabledevelopment/es/>), contribuyendo en cierta medida a su logro: Objetivo 8: Promover el crecimiento económico inclusivo y sostenible, el empleo y el trabajo decente para todos. Meta 8.1 Mantener el crecimiento económico per cápita de conformidad con las circunstancias nacionales y, en particular, un crecimiento del producto interno bruto de al menos el 7% anual en los países menos adelantados.

### 2. Resultados de aprendizaje

- Conoce las metodologías y técnicas cuantitativas descritas, así como su aplicación.
- Es capaz de interpretar los resultados obtenidos en los mercados financieros abordados.
- Puede diseñar modelizaciones ad hoc en cualquier mercado financiero y aplicar contrastes que validen sus resultados.

### 3. Programa de la asignatura

- 1) Datos de panel
- 2) Series temporales
  - 2.1) Técnicas univariantes
  - 2.2) Técnica multivariantes
- 3) Otros métodos cuantitativos en finanzas

### 4. Actividades académicas

La asignatura se desarrollará mediante clases teórico-prácticas. Dado el carácter instrumental de la asignatura, su impartición está fundamentada en el principio "learning-by-doing". De este modo en una primera etapa se proporciona al estudiante los contenidos y metodologías a utilizar, así como ámbito de aplicación. Paralelamente se expone, resuelve y discute un caso práctico de aplicación. En una segunda etapa el estudiante aplica los conceptos y métodos aprendidos en la resolución de uno o varios casos propuestos por el profesor.

- Obtención y tratamiento de la información: 15 horas
- Presentación de contenidos teóricos: 15 horas
- Presentación y resolución de casos prácticos utilizando herramientas informáticas: 50 horas
- Realización y presentación de trabajos individuales: 20 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

En primera convocatoria, existen dos sistemas de evaluación:

a) Evaluación continua, que consistirá en la realización de pruebas de carácter individual a lo largo de todo el periodo lectivo consistentes en la resolución de trabajos empíricos propuestos por el profesor y en el que el estudiante deberá aplicar todas y cada una de las metodologías descritas en las sesiones de clase. Asimismo, se evaluará la realización de tareas complementarias que se plantearán en las sesiones presenciales, así como la participación activa en las mismas.

La distribución del peso de las diferentes pruebas es la siguiente:

- Pruebas prácticas: 50%
- Realización de las tareas que se planteen en las sesiones presenciales y participación activa en las mismas: 50%

Para superar la asignatura por esta vía será necesario que el resultado de la ponderación anterior sea superior a 5 puntos sobre 10.

b) Sistema de evaluación global, mediante un examen individual de contenido teórico-práctico, que se realizará en la fecha y hora establecidas en la convocatoria oficial. Este examen consistirá en la resolución de un trabajo empírico facilitado por el docente sobre la materia de la asignatura. Para superar la asignatura el estudiante deberá obtener en el examen una puntuación superior a 5 sobre 10.

En la segunda convocatoria, la evaluación se realizará únicamente mediante un examen final de contenido teórico-práctico.

Está previsto que estas pruebas se realicen de manera presencial, pero si las circunstancias sanitarias lo requieren, se realizarán de manera semipresencial u online. En el caso de evaluación online, es importante destacar que, en cualquier prueba, el estudiante podrá ser grabado, pudiendo este ejercer sus derechos por el procedimiento indicado en: [https://protecciondatos.unizar.es/sites/protecciondatos.unizar.es/files/users/lopd/gdocencia\\_reducida.pdf](https://protecciondatos.unizar.es/sites/protecciondatos.unizar.es/files/users/lopd/gdocencia_reducida.pdf)

Los aspectos que se tendrán en cuenta a la hora de fijar las calificaciones serán, entre otros, la precisión y claridad en la definición teórica de los términos y conceptos financieros, el correcto uso de lenguaje técnico referente a los modelos de tratamiento de información financiera y otros conceptos objeto de estudio de la asignatura y la corrección en el planteamiento y resolución de las cuestiones prácticas.