FICHA IDENTIFICATIVA

DATOS DE LA ASIGNATURA

Código: 35856
Nombre: Técnicas cuantitativas en Finanzas
Ciclo: Grado
Créditos ECTS: 4,5
Curso académico: 2026-27

TITULACIONES

Titulación	Centro	Curso	Periodo
1313 - Grado en Administración y Dirección de Empresas	Facultat d'Economia	4	Primer cuatrimestre

MATERIAS

Titulación	Materia	Carácter
1313 - Grado en Administración y Dirección de Empresas	Técnicas Cuantitativas en Finanzas	OPTATIVA

COORDINACIÓN

BRETO MARTINEZ CARLES

RESUMEN

El objetivo central de la asignatura es exponer a los estudiantes a los fundamentos y práctica de técnicas cuantitativas adecuadas para el análisis de la realidad financiera. Los temas principales que se abordan son las propiedades estadísticas de series temporales de variables financieras y la estimación de modelos a partir de datos reales de cara a la valoración de carteras y a la toma de decisiones.

isiones.

CONOCIMIENTOS PREVIOS

RELACIÓN CON OTRAS ASIGNATURAS DE LA MISMA TITULACIÓN

No se han especificado restricciones de matrícula con otras asignaturas del plan de estudios.

OTROS TIPOS DE REQUISITOS

Se recomienda haber cursado con aprovechamiento las materias de Matemáticas I y II, Estadística I y II y Econometría.

COMPETENCIAS / RESULTADOS DE APRENDIZAJE

1313 - Grado en Administración y Dirección de Empresas

Capacidad crítica y autocrítica.

Capacidad de análisis y síntesis.

Capacidad de tomar decisiones.

Capacidad para aplicar métodos analíticos y matemáticos para el análisis de los problemas económicos y empresariales.

Capacidad para definir, resolver y exponer de forma sistémica problemas complejos.

Capacidad para expresarse en lenguajes formales, gráficos y simbólicos.

Capacidad para la resolución de problemas.

Capacidad para tomar decisiones en ambientes de certidumbre e incertidumbre.

Conocer y saber utilizar adecuadamente los diferentes métodos cuantitativos y cualitativos apropiados para razonar analíticamente, evaluar resultados y predecir magnitudes económicas y financieras.

Habilidad para analizar y buscar información proveniente de fuentes diversas.

Motivación por la calidad.

DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS

1. Datos y mercados financieros

2. Propiedades estadísticas de los rendimientos financieros

3. Modelos ARIMA

4. Análisis de la volatilidad. Modelos ARCH

VOLUMEN DE TRABAJO (HORAS)

ACTIVIDADES PRESENCIALES

Actividad	Horas
Teoría	30,00
Prácticas en aula	15,00
Total horas	**45,00**

ACTIVIDADES NO PRESENCIALES

Actividad	Horas
Asistencia a otras actividades	0,00
Elaboración de trabajos individuales o en grupo	0,00
Estudio y trabajo autónomo	45,00
Preparación de clases	22,50
Preparación de actividades de evaluación	0,00
Resolución de casos prácticos	0,00
Total horas	**67,50**

METODOLOGÍA DOCENTE

La docencia se estructurará alrededor de clases teóricas y de clases prácticas. En las clases teóricas, se expondrán los aspectos centrales de la materia, motivados a partir de casos reales y problemas concretos. Estos casos reales y problemas concretos se abordarán también en las clases prácticas, en las cuales el foco estará en la resolución de dichos problemas y en el estudio y análisis de los datos de dichos casos reales.

Para que el aprovechamiento del curso sea completo, será fundamental que cada persona disponga de un ordenador portátil propio donde pueda instalar programas y librerías sobre la marcha.

p>

EVALUACIÓN

Calificación global de la asignatura: examen final (70%) + evaluación continua (30%).

Para superar la asignatura, será necesario haber aprobado el examen final. La evaluación continua ser hará a lo largo del curso académico y podrá incluir trabajos, ejercicios, pruebas parciales y participación en actividades en el aula.

pan>

BIBLIOGRAFÍA

- Hyndman, R.J., & Athanasopoulos, G. (2021) Predicción: principios y práctica, edición tercera, OTexts: Melbourne, Australia. https://otexts.com/fppsp
- Tsay, R. S. (2010). Analysis of financial time series [electronic resource] / Ruey S. Tsay. (3rd edition). Hoboken, NJ: Wiley. https://trobes.uv.es/permalink/34CVA_UV/um6gse/alma991009620333106258
- Tsay, R. S. (2010). Analysis of financial time series / Ruey S. Tsay., the University of Chicago Booth School of Business Chicago, IL (Third Edition). Hoboken, New Jersey: Wiley. https://trobes.uv.es/permalink/34CVA_UV/um6gse/alma991009573315206258
- Wooldridge, J. M. (2015). Introducción a la econometría: un enfoque moderno / Jeffrey M. Wooldridge traducción Ma. del Carmen Enriqueta Hano Roa, Érika M. Jasso Hernan d' Borneville (5a ed). México DF: Cengage Learning. https://trobes.uv.es/permalink/34CVA_UV/um6gse/alma991001861329706258
- Wooldridge, J. M. (2011). Introducción a la econometría: un enfoque moderno / Jeffrey M. Wooldridge traducción Ma. del Carmen Enriqueta Hano Roa, Érika M. Jasso Hernan d' Borneville (4a ed.). México DF: Cengage Learning. https://trobes.uv.es/permalink/34CVA_UV/um6gse/alma991006612259706258