FITXA IDENTIFICATIVA

DADES DE L'ASSIGNATURA

Codi: 35856
Nom: Tècniques quantitatives en finances
Cicle: Grau
Crèdits ECTS: 4,5
Curs acadèmic: 2025-26

TITULACIONS

Titulació	Centre	Curs	Periode
1313 - Grau en Administració i Direcció d'Empreses	Facultat d'Economia	4	Primer quadrimestre

MATÈRIES

Titulació	Matèria	Caràcter
1313 - Grau en Administració i Direcció d'Empreses	Técnicas Cuantitativas en Finanzas	OPTATIVA

COORDINACIÓ

BRETO MARTINEZ CARLES

RESUM

L'objectiu central de l'assignatura és exposar als estudiants als fonaments i pràctica de tècniques quantitatives adequades per a l'anàlisi de la realitat financera. Els temes principals que s'aborden són les propietats estadístiques de sèries temporals de variables financeres i l'estimació de models a partir de dades reals de cara a la valoració de carteres i a la presa de decisions.

>

CONEIXEMENTS PREVIS

RELACIÓ AMB ALTRES ASSIGNATURES DE LA MATEIXA TITULACIÓ

No s'ha especificat restriccions de matrícula amb altres assignatures del pla d'estudis.

ALTRES TIPUS DE REQUISITS

Es recomana haver cursat amb aprofitament les matèries de Matemàtiques I i II, Estadística I i II i Econometria.

COMPETÈNCIES / RESULTATS D' APRENENTATGE

1313 - Grau en Administració i Direcció d'Empreses

Capacitat crítica i autocrítica.

Capacitat d'anàlisi i síntesi.

Capacitat de prendre decisions.

Capacitat per a aplicar mètodes analítics i matemàtics per a l'anàlisi dels problemes econòmics i empresarials.

Capacitat per a definir, resoldre i exposar de forma sistèmica problemes complexos.

Capacitat per a expressar-se en llenguatges formals, gràfics i simbòlics.

Capacitat per a la resolució de problemes.

Capacitat per a prendre decisions en ambients de certitud i incertesa.

Conèixer i saber utilitzar adequadament els diferents mètodes quantitatius i qualitatius apropiats per raonar analíticament, avaluar resultats i predir magnituds econòmiques i financeres.

Habilitat per a analitzar i buscar informació provinent de fonts diverses.

Motivació per la qualitat.

DESCRIPCIÓ DE CONTINGUTS

1. Dades i mercats financers

2. Propietats estadístiques dels rendiments financers

3. Models ARIMA

4. Anàlisi de la volatilitat. Models ARCH

VOLUM DE TREBALL (HORES)

ACTIVITATS PRESENCIALS

Activitat	Hores
Teoria	30,00
Pràctiques a l'aula	15,00
Total hores	**45,00**

ACTIVITATS NO PRESENCIALS

Activitat	Hores
Assistència a altres activitats	0,00
Elaboració de treballs individuals o en grup	0,00
Estudi i treball autònom	45,00
Preparació de classes	22,50
Preparació d'activitats d'avaluació	0,00
Resolució de casos pràctics	0,00
Total hores	**67,50**

METODOLOGIA DOCENT

La docència s'estructurarà al voltant de classes teòriques i de classes pràctiques. En les classes teòriques, s'exposaran els aspectes centrals de la matèria, motivats a partir dades reals i problemes concrets. Aquestes dades reals i problemes concrets s'abordaran també en les classes pràctiques, en les quals el centre d'atenció estarà en la resolució d'aquests problemes i en l'estudi i anàlisi de les dades d'aquests casos reals.

s.

AVALUACIÓ

Qualificació global de l'assignatura: examen final (70%) + avaluació contínua (30%).

Per a superar l'assignatura, serà necessari haver aprovat l'examen final. L'avaluació contínua es farà al llarg del curs acadèmic i podrà incloure treballs, exercicis, proves parcials i participació en activitats a l'aula.

BIBLIOGRAFIA

- 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 dBorneville (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 dBorneville (4a ed.). México DF: Cengage Learning. https://trobes.uv.es/permalink/34CVA_UV/um6gse/alma991006612259706258