



## FICHA IDENTIFICATIVA

### DATOS DE LA ASIGNATURA

**Código:** 42204

**Nombre:** Econometría financiera

**Ciclo:** Máster Universitario Oficial

**Créditos ECTS:** 6

**Curso académico:** 2025-26

### TITULACIONES

Titulación	Centro	Curso	Periodo
2081 - Máster Universitario en Banca y Finanzas Cuantitativas	Facultat d'Economia	1	Anual

### MATERIAS

Titulación	Materia	Carácter
2081 - Máster Universitario en Banca y Finanzas Cuantitativas	Materias obligatorias	OBLIGATORIA

### COORDINACIÓN

BRETO MARTINEZ CARLES

## RESUMEN

Se aprende a aplicar distintas técnicas de estimación y contrastes cuantitativos a datos financieros, empleando diferente software, para tomar decisiones óptimas en base a los resultados obtenidos y valorar y analizar carteras.

## 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

Relación con otras asignaturas de la misma titulación:  
Econometría financiera se imparte en el segundo trimestre del primer curso.

Las siguientes dos asignaturas, que se imparten en el primer trimestre, proporcionan conocimientos previos necesarios:

- La asignatura Matemáticas y Estadística introduce los conceptos matemáticos y estadísticos básicos que serán fundamentales en el estudio y análisis cuantitativo de los mercados financieros.



- La asignatura Fundamentos de Economía Financiera I presenta

## COMPETENCIAS / RESULTADOS DE APRENDIZAJE

## DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS

1. Tema 1. Especificación y diagnóstico de modelos de regresión en contexto de datos de sección cruzada y serie temporal

2. Tema 2. Contrastes del modelo de valoración de activos financieros con cartera de mercado, CAPM

## VOLUMEN DE TRABAJO (HORAS)

### ACTIVIDADES PRESENCIALES

Actividad	Horas
Teoría	30,00
Prácticas en aula	15,00
Aula informática	15,00
<b>Total horas</b>	<b>60,00</b>

### ACTIVIDADES NO PRESENCIALES

Actividad	Horas
Asistencia a otras actividades	0,00
Elaboración de trabajos individuales o en grupo	0,00
Estudio y trabajo autónomo	0,00
Preparación de clases	0,00
Preparación de actividades de evaluación	0,00
Resolución de casos prácticos	0,00
<b>Total horas</b>	<b>0,00</b>

## METODOLOGÍA DOCENTE

Clase magistral, prácticas en aula y prácticas con ordenador.

## EVALUACIÓN



La evaluación constará de tareas individuales y/o en grupo realizadas a lo largo del curso y exposiciones orales. Asimismo, se exigirá superar un examen escrito que ponderará al menos el 70% de la nota final.

## BIBLIOGRAFÍA

- Campbell, J. Y., Lo, A. W. y MacKinlay, A. C. (1997). The Econometrics of Financial Markets. Princeton University Press. - Davidson, R. y MacKinnon, J. G. (2004). Econometric Theory and Methods. Oxford University Press. - Greene, W. H. (2008). Econometric Analysis. Prentice Hall, sexta edición. - Marín, J.M. y Rubio, G. (2001). Economía Financiera. Antoni Bosch, Barcelona.