

**FITXA IDENTIFICATIVA****DADES DE L'ASSIGNATURA**

**Codi:** 42204  
**Nom:** Econometria financera  
**Cicle:** Màster Universitari Oficial  
**Crèdits ECTS:** 6  
**Curs acadèmic:** 2026-27

**TITULACIONS**

Titulació	Centre	Curs	Període
2081 - Màster Universitari en Banca i Finances Quantitatives	Facultat d'Economia	1	Anual

**MATÈRIES**

Titulació	Matèria	Caràcter
2081 - Màster Universitari en Banca i Finances Quantitatives	Matèries obligatòries	OBLIGATÒRIA

**COORDINACIÓ**

BRETO MARTINEZ CARLES

**RESUM**

S'aprèn a aplicar diferents tècniques econòmriques d'estimació i contrastos quantitius a dades financeres, emprant diferent programari, per prendre decisions òptimes en base als resultats obtinguts i valorar i analitzar carteres.

teres.

**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**

Relació amb altres assignatures de la mateixa titulació

Econometria financera s'imparteix en el segon trimestre del primer curs.

Les següents dues assignatures, que s'imparteixen en el primer trimestre, proporcionen coneixements



previs necessaris:

- L'assignatura Matemàtiques i Estadística introdueix els conceptes matemàtics i estadístics bàsics que seran fonamentals en l'estudi i anàlisi quantitativa dels mercats financers.
- L'assignatura Fonaments d'Economia Financera I presenta els fonaments del

## COMPETÈNCIES / RESULTATS D' APRENTATGE

## DESCRIPCIÓ DE CONTINGUTS

**1. Tema 1. Especificació, estimació i diagnòstic de models de regressió en context de dades de secció creuada i sèrie temporal.**

**2. Tema 2. Contrastos del model de valoració d'actius financers amb cartera de mercat, CAPM**

## VOLUM DE TREBALL (HORES)

### ACTIVITATS PRESENCIALS

Activitat	Hores
Teoria	30,00
Pràctiques a l'aula	15,00
Aula informàtica	15,00
<b>Total hores</b>	<b>60,00</b>

### ACTIVITATS NO PRESENCIALS

Activitat	Hores
Assistència a altres activitats	0,00
Elaboració de treballs individuals o en grup	0,00
Estudi i treball autònom	0,00
Preparació de classes	0,00
Preparació d'activitats d'avaluació	0,00
Resolució de casos pràctics	0,00
<b>Total hores</b>	<b>0,00</b>

## METODOLOGIA DOCENT

Classes magistrals, pràctiques en aula i pràctiques amb ordinador.



## AVALUACIÓ

L'avaluació constarà de tasques individuals i / o en grup realitzades al llarg del curs i exposicions orals. Així mateix, es podrà exigir un examen escrit final.

nal.

## BIBLIOGRAFIA

- 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 edició. - Marín, J.M. y Rubio, G. (2001). Economía Financiera. Antoni Bosch, Barcelona.