

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

**Codi:** 42211  
**Nom:** Econometria financera (ampliació)  
**Cicle:** Màster Universitari Oficial  
**Crèdits ECTS:** 6  
**Curs acadèmic:** 2025-26

**TITULACIONS**

Titulació	Centre	Curs	Període
2081 - Màster Universitari en Banca i Finances Quantitatives	Facultat d'Economia	2	Anual

**MATÈRIES**

Titulació	Matèria	Caràcter
2081 - Màster Universitari en Banca i Finances Quantitatives	Matèries optatives	OPTATIVA

**COORDINACIÓ**

TORRO I ENGUIX HIPOLIT

**RESUM****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****COMPETÈNCIES / RESULTATS D' APRENTATGE****DESCRIPCIÓ DE CONTINGUTS**



## 1. Tema 1. L'aplicació pràctica de mètodes econòmètrics bàsics: una valoració

## 2. Tema 2. Sèries temporals univariants

- o Processos estocàstics.
- o Estacionarietat.
- o Funcions d'autocorrelació simple i parcial
- o Models ARMA. Especificació del model.
- o Contrastos d'arrel unitària.
- o Models ARIMA. Estimació i diagnosi
- o Components de curt i llarg termini en una sèrie temporal
- o Filtre Hodrick-Prescott

## 3. Tema 3. Models GARCH univariants

- o Propietats. Models asimètrics. Models en mitjana.
- o Estimació. Imposició d'un nivell de volatilitat de llarg termini

## 4. Tema 4. Models Vectorials autoregressius (VAR)

- o Models VAR
- o Regressió espúria
- o Cointegració
- o Contrastos de cointegració: Els enfocaments de Engle-Granger i de Johansen
- o El model de correcció de l'error
- o Common features
- o Pairs trading

5.

6.

7.



## 8. Tema 8. Mètode Generalitzat de Moments: Aplicacions financeres

- o Exemples senzills: Student-t, Johnson's U
- o Estimació d'una classe de models model de tipus d'interès
- o Valoració d'actius en equilibri: asset pricing

### 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 teòriques, exercicis i pràctiques amb ordinador realitzats individualment o en grups pels alumnes.

### AVALUACIÓ

### BIBLIOGRAFIA

- Notas de clase Hamilton, J.D. (1994), Time Series Analysis, Ed. Princeton University Press
- Tsay, R.S. (2010), Analysis of Financial Time Series, Wiley-Interscience, Third Edition
- Franses, P.H. and Dick van Dijk (2000), Non-linear time series models in empirical finance, Cambridge University Press.
- Diebold, F.X. and K. Yilmaz, (2015), Financial and Macroeconomic Connectedness: A Network Approach to Measurement and Monitoring, Oxford University Press
- Campbell, A. Lo, y A.C. MacKinlay (1997), The econometrics of financial markets, Princeton University Press
- Hamilton, J. (1999), Time series analysis, Princeton University Press
- Novales,



A. (1993), Econometria, Mc Graw-Hill