

PLAN DOCENTE DE LA ASIGNATURA¹

Curso académico: año de impartición 2025/2026

Identificación y características de la asignatura			
Código ²	502348	Créditos ECTS	6
Denominación (español)	Econometría Aplicada a las Finanzas I		
Denominación (inglés)			
Titulaciones ³	Grado en Finanzas y Contabilidad		
Centro ⁴	Facultad de Empresa, Finanzas y Turismo		
Semestre		Carácter	Obligatorio
Módulo	Métodos Cuantitativos para las Finanzas y Contabilidad		
Materia	Econometría		
Profesorado			
Nombre	Despacho	Correo-e	Página web
Área de conocimiento			
Departamento			
Profesor/a coordinador/a ⁵ (si hay más de uno)			
Competencias ⁶			
BÁSICAS			
<p>CB1 - Que los estudiantes hayan demostrado poseer y comprender conocimientos en un área de estudio que parte de la base de la educación secundaria general, y se suele encontrar a un nivel que, si bien se apoya en libros de texto avanzados, incluye también algunos aspectos que implican conocimientos procedentes de la vanguardia de su campo de estudio.</p> <p>CB2 - Que los estudiantes sepan aplicar sus conocimientos a su trabajo o vocación de una forma profesional y posean las competencias que suelen demostrarse por medio de la elaboración y defensa de argumentos y la resolución de problemas dentro de su área de estudio.</p> <p>CB3 - Que los estudiantes tengan la capacidad de reunir e interpretar datos relevantes (normalmente dentro de su área de estudio) para emitir juicios que incluyan una reflexión sobre temas relevantes de índole social, científica o ética.</p>			

¹ En los casos de planes conjuntos, coordinados, intercentros, pceos, etc., debe recogerse la información de todos los títulos y todos los centros en una única ficha.

² Si hay más de un código para la misma asignatura, ponerlos todos.

³ Si la asignatura se imparte en más de una titulación, consignarlas todas, incluidos los PCEOs.

⁴ Si la asignatura se imparte en más de un centro, incluirlos todos

⁵ En el caso de asignaturas intercentro, debe rellenarse el nombre del responsable intercentro de cada asignatura

⁶ Deben ajustarse a lo recogido en la memoria verificada del título.

<p>CB4 - Que los estudiantes puedan transmitir información, ideas, problemas y soluciones a un público tanto especializado como no especializado.</p> <p>CB5 - Que los estudiantes hayan desarrollado aquellas habilidades de aprendizaje necesarias para emprender estudios posteriores con un alto grado de autonomía.</p>
<p>GENERALES</p>
<p>CG1 - Capacidad de aprendizaje autónomo en el ámbito de los conocimientos y las competencias relacionadas con el desempeño de tareas y funciones financieras y contables que le permitan emprender actividades más complejas o continuar el aprendizaje de técnicas propias de especialista en el área de las fianzas y la contabilidad.</p> <p>CG2 - Capacidad de adaptación a nuevas situaciones y circunstancias a consecuencia de las cuales se han de proponer actuaciones y tomar decisiones con agilidad y espíritu crítico.</p> <p>CG3 - Creatividad e innovación en todos los ámbitos de la dirección y gestión, proponiendo o buscando nuevas soluciones o procedimientos más eficientes que las actuales.</p> <p>CG4 - Liderar, defender, argumentar y proponer opiniones y actuaciones en pos de la resolución de problemas relacionados con la dirección y la gestión.</p> <p>CG5 - Iniciativa y espíritu emprendedor para adaptarse a las nuevas circunstancias y al entorno cambiante en el que operan las empresas de manera eficiente y eficaz.</p> <p>CG6 - Motivación por la calidad, supervisando el trabajo realizado por los subordinados, contrastando la opinión de los usuarios de la función financiera y contable en relación con las expectativas que estos tenían.</p> <p>CG7 - Sensibilidad hacia temas medioambientales y sociales, siendo capaz de reconocer y abordar estas cuestiones de manera apropiada.</p>
<p>TRANSVERSALES</p>
<p>CT3 - Dominio de las TIC.</p> <p>CT5 - Capacidad para tomar decisiones.</p> <p>CT9 - Capacidad de aprendizaje autónomo.</p>
<p>ESPECÍFICAS</p>
<p>CE31 - Ser capaz de elaborar y construir modelos estadísticos y econométricos útiles para el análisis de la volatilidad y la posible relación lineal de series financieras con la finalidad de obtener conclusiones y analizar críticamente los resultados derivados de dichos modelos, así como manejar software estadístico y econométrico a nivel avanzado.</p>
<p>Contenidos⁶</p>
<p>Breve descripción del contenido</p>

Se iniciará al estudiante en los conceptos de procesos estocásticos y varianza condicional así como en los concepto de Econometría, volatilidad y estacionariedad, todos ellos profundamente ligados a la estructura de datos financieros. También se estudiarán modelos estadísticos y econométricos apropiados para el análisis de series financieras, como son los modelos ARIMA, y modelos apropiados para el análisis de la volatilidad, como son los modelos ARCH y GARCH. Finalmente, se analizará la relación entre variables financieras por medio del modelo de regresión lineal. Todos estos conceptos y modelos se aplicarán a datos financieros reales mediante el manejo avanzado de software estadístico.

Temario de la asignatura

Denominación del tema 1:
 Contenidos del tema 1:
 Descripción de las actividades prácticas del tema 1:

Denominación del tema 2:
 Contenidos del tema 2:
 Descripción de las actividades prácticas del tema 2:

Denominación del tema 3:
 Contenidos del tema 3:
 Descripción de las actividades prácticas del tema 3:

Denominación del tema n:
 Contenidos del tema n:
 Descripción de las actividades prácticas del tema n:

Actividades formativas⁷

Horas de trabajo del alumno/a por tema		Horas Gran grupo	Actividades prácticas				Actividad de seguimiento	No presencial
Tema	Total	GG	PCH	LAB	ORD	SEM	TP	EP
1								
2								
3								
...								
Evaluación⁸								
TOTAL								

GG: Grupo Grande (100 estudiantes).
 PCH: prácticas clínicas hospitalarias (7 estudiantes)
 LAB: prácticas laboratorio o campo (15 estudiantes)
 ORD: prácticas sala ordenador o laboratorio de idiomas (30 estudiantes)
 SEM: clases problemas o seminarios o casos prácticos (40 estudiantes).
 TP: Tutorías Programadas (seguimiento docente, tipo tutorías ECTS).
 EP: Estudio personal, trabajos individuales o en grupo, y lectura de bibliografía.

Metodologías docentes⁶

⁷ Esta tabla debe coincidir exactamente con lo establecido en la ficha 12c de la asignatura.
⁸ Indicar el número total de horas de evaluación de esta asignatura.

Método expositivo que consiste en la presentación por parte del profesor de los contenidos sobre la materia objeto de estudio. También incluye la resolución de problemas ejemplo por parte del profesor.

Método basado en el planteamiento de problemas por parte del profesor y la resolución de los mismos en el aula. Los estudiantes de forma colaborativa desarrollan e interpretan soluciones adecuadas a partir de la aplicación de procedimientos de resolución de problemas.

Estudio de casos; proyectos y experimentos. Análisis intensivo y completo de un caso real, proyecto, simulación o experimento con la finalidad de conocerlo, interpretarlo, resolverlo, generar hipótesis, contrastar datos, reflexionar, completar conocimientos, diagnosticarlo y, a veces, entrenarse en los posibles procedimientos alternativos de solución.

Actividades colaborativas basadas en recursos y herramientas digitales, especialmente aquellas que posee el CVUEx.

Situación de aprendizaje/evaluación en la que el alumno realiza alguna prueba que sirve para reforzar su aprendizaje y como herramienta de evaluación.

Resultados de aprendizaje⁶

Conocer la estructura de los datos financieros con el fin de medir y controlar la volatilidad de las variables financieras mediante la aplicación de modelos ARIMA y modelos de heterocedasticidad condicional (ARCH y GARCH).

Conocer las relaciones entre variables financieras y ser capaz de ajustar un modelo de regresión lineal para estimar modelos de valoración de activos financieros.

Conocer y manejar a nivel avanzado software estadístico.

Sistemas de evaluación⁶

Bibliografía (básica y complementaria)

Otros recursos y materiales docentes complementarios