



Asignatura: **Econometría II**  
Código: 18272  
Centro: **Ciencias Económicas**  
Titulación: **Economía y Finanzas**  
Nivel: **Grado**  
Tipo: **Obligatoria**  
Nº. de Créditos:  
Curso Académico: **2012 - 2013**

## ASIGNATURA / COURSE TITLE

### 1.1. Código / Course number

18272

### 1.2. Materia/ Content area

Econometría / [Econometrics II](#)

### 1.3. Tipo / Course type

Obligatoria

### 1.4. Nivel / Course level

Grado/ [Degree](#)

### 1.5. Curso / Year

Tercero/ [Third](#)

### 1.6. Semestre / Semester

Segundo/ [Second](#)

### 1.7. Número de créditos / Credit allotment

6 ECTS/6 [credits](#)

### 1.8. Requisitos previos / Prerequisites

Econoemtría I, así como conocimiento básico de Álgebra Matricial, Cálculo y Estadística/[Econometrics I](#), and basic knowledge of [Matrix Algebra](#), [Calculus](#) and [Statistics](#).



Asignatura: **Econometría II**  
Código: 18272  
Centro: **Ciencias Económicas**  
Titulación: **Economía y Finanzas**  
Nivel: **Grado**  
Tipo: **Obligatoria**  
Nº. de Créditos:  
Curso Académico: **2012 - 2013**

### 1.9. Requisitos mínimos de asistencia a las sesiones presenciales/ **Minimum attendance requirement**

No hay requisitos mínimos de asistencia, si bien la participación activa en las clases, así como la entrega de los ejercicios y trabajos propuestos, tendrán influencia en la nota final como parte de la evaluación continua/**There are no minimum requiremet for attendance, although the active class participation as well as homeworks will influence the final grade.**

### 1.10. Datos del equipo docente / **Faculty data**

**Alvarez Espinosa, M. Angel** miguelangel.alvarez@uam.es **MOD 3, 310**  
**García Ferrer, Antonio** antonio.garcia@uam.es **MOD 3, 305**  
**del Hoyo Bernat, Juan** Juan.hoyo@uam.es **MOD 3, 303**  
**de Juan Fernández, Aránzazu** aranzazu.dejuan@uam.es **MOD 3, 306**  
**Martín Arroyo, Antonio** a.martin@uam.es **MOD 3, 306**  
**Poncela Blanco, Pilar** pilar.poncela@uam.es **MOD 3, 301-A**  
**Rodriguez Puerta, Julio** jr.puerta@uam.es **MOD 3, 309**  
**Sanchez Mangas, Rocio** rocio.sanchez@uam.es **MOD 3, 301-B**

### 1.11. Objetivos del curso / **Course objectives**

Familiarizar al estudiante con los métodos econométricos propios del análisis financiero o adaptados al mismo. Introducir las técnicas de simulación. /**To introduce financial econometrics topics or to adapt the existing ones to finance. To introduce simulation methods.**

### 1.12. Contenidos del programa / **Course contents**

T. 1: Modelos multivariantes  
T.2: Relaciones de largo plazo en finanzas  
T.3: Volatilidad y correlación con datos financieros  
T.4: Modelos de regímenes  
T.5: Técnicas de simulación

**Ch. 1: Multivariate models**  
**Ch.2: Modelling long-run relationships in finance**  
**Ch.3: Modelling volatility and correlation**  
**Ch.4: Switching models**  
**Ch.5: Simulation techniques**



Asignatura: **Econometría II**  
Código: 18272  
Centro: **Ciencias Económicas**  
Titulación: **Economía y Finanzas**  
Nivel: **Grado**  
Tipo: **Obligatoria**  
Nº. de Créditos:  
Curso Académico: **2012 - 2013**

### 1.13. Referencias de consulta / **Course bibliography**

*Introductory econometrics for finance*, Chris Brook, Editorial Cambridge University Press.

### 2. Métodos Docentes / **Teaching methodology**

La metodología docente consistirá en clases teóricas regulares y clases prácticas en las que se manejarán distintas aplicaciones informáticas. Además, los alumnos deberán realizar aplicaciones empíricas en las que aplicarán a problemas con datos financieros los conocimientos adquiridos en el curso. /

**Teaching methodology consists on lectures as well as practical examples, both in the classroom and lab. Students must also work on empirical exercises with real data.**

### 3. Tiempo de trabajo del estudiante / **Student workload**

Esta asignatura tiene asignados 6 créditos ECTS que equivalen a 150 horas de trabajo para el estudiante. / **This course gives the student 6 credits, which means 150 working hours.**

### 4. Métodos de evaluación y porcentaje en la calificación final / **Evaluation procedures and weight of components in the final grade**

Evaluación continua (30%). Esto puede incluir resolución de problemas, trabajos aplicados y participación activa en clase.

Examen final (70%).

**Continuos evaluation (30%). This can include applied work, homeworks and active class participation.**

**Final exam (70%).**



Asignatura: **Econometría II**  
Código: 18272  
Centro: **Ciencias Económicas**  
Titulación: **Economía y Finanzas**  
Nivel: **Grado**  
Tipo: **Obligatoria**  
Nº. de Créditos:  
Curso Académico: **2012 - 2013**

## 5. Cronograma\* / [Course calendar](#)

<b>Semana</b>	<b>Contenido</b>
1-3	Tema 1
4-6	Tema 2
7-9	Tema 3
10-12	Tema 4
13-15	Tema 5

\*Este cronograma tiene carácter orientativo

<b>Week</b>	<b>Contents</b>
1-3	Chapter 1
4-6	Chapter 2
7-9	Chapter 3
10-12	Chapter 4
13-15	Chapter 5

\*This schedule is orientative