



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](#)

Semana	Contenido
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

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

*This schedule is orientative