



DENOMINACIÓN ASIGNATURA: Econometría Financiera		
GRADO: Finanzas y Contabilidad	CURSO: 4	CUATRIMESTRE: 1

PLANIFICACIÓN SEMANAL DE LA ASIGNATURA								
SEMANA	SESIÓN	DESCRIPCIÓN DEL CONTENIDO DE LA SESIÓN	GRUPO (marcar X)		Indicar espacio distinto de aula (aula informática, audiovisual, etc.)	TRABAJO SEMANAL DEL ALUMNO		
			GRANDE	PEQUEÑO		DESCRIPCIÓN	HORAS PRESENCIALES	HORAS TRABAJO (Max. 7h semana)
1	1	Objetivos: características empíricas de datos financieros	x				1,5	6
1	2	Análisis empírico de datos financieros		x	Informática	Estudio	1,5	
2	3	Diferencias entre incorrelación e independencia	x				1,5	6
2	4	Análisis empírico de datos financieros		x	Informática	Estudio	1,5	
3	5	El modelo ARCH: interpretación	x				1,5	6
3	6	Implementación del modelo ARCH		x	Informática	Estudio	1,5	
4	7	Ajuste del modelo ARCH: análisis de residuos	x				1,5	6
4	8	Implementación del modelo GARCH		x	Informática	Realización de ejercicios 1	1,5	
5	9	El modelo GARCH	x				1,5	6
5	10	Resolución de ejercicios 1		x		Estudio	1,5	

6	11	Modelo GARCH integrado	x				1,5	6
6	12	Implementación del modelo GARCH		x	Informática	Estudio	1,5	
7	13	Modelo GARCH asimétrico	x				1,5	6
7	14	Prueba parcial 1		x		Estudio	1,5	
8	15	Predicción de la volatilidad	x				1,5	6
8	16	Predicción de la volatilidad de series reales		x	Informática	Realización de ejercicios 2	1,5	
9	17	Calculo del valor en riesgo	x				1,5	6
9	18	Resolución de ejercicios 2		x		Estudio	1,5	
10	19	Modelos GARCH multivariantes: dificultades	x				1,5	6
10	20	Implementación de modelos GARCH multivariantes		x	Informática	Estudio	1,5	
11	21	Modelos GARCH multivariantes: BEKK y DCC	x				1,5	6
11	22	Implementación de modelos GARCH multivariantes		x	Informática	Estudio	1,5	
12	23	Predicción de la correlación entre activos	x				1,5	6
12	24	Prueba parcial 2		x		Realización de ejercicios 3	1,5	
13	25	Modelos GARCH para carteras de valores	x				1,5	6
13	26	Predicción de la correlación entre activos		x	Informática	Estudio	1,5	
14	27	Repaso de contenidos	x				1,5	6
14	28	Resolución de ejercicios 3		x		Estudio	1,5	

Subtotal 1 42 84

Total 1 <i>(Horas presenciales y de trabajo del alumno entre las semanas 1-14)</i>	126
---	------------

15		Recuperaciones, tutorías, entrega de trabajos, etc						
16		Preparación de evaluación y evaluación					3	21
17								
18								

Subtotal 2 3 21

Total 2 <i>(Horas presenciales y de trabajo del alumno entre las semanas 15-18)</i>	24
--	-----------

TOTAL <i>(Total 1 + Total 2)</i>	150
---	------------