

	Proceso: Formulación del Currículo y Plan de Estudios Guía de Cátedra	Código:	DOC11-FO-01
		Versión:	3
		Fecha:	23/05/2019
		Hoja:	Página 1 de 2

1. Identificación del Curso/ Módulo			
Nombre del Curso/ Módulo: ESTADISTICA APLICADA, MERCADOS Y ECONOMETRIA FINANCIERA	Línea de conocimiento: FINA	Código de materia: FINA 16165	Número de credits: 2
Facultad/ Departamento	FAC DE CIEN ECON ADM Y CONTAB		
Programa que Administra el curso o módulo	MAESTRIA EN FINANZAS		
Niveles de Formación	Técnico Profesional		Especialización
	Tecnológico Profesional		Maestría
	Profesional		Doctorado
Modalidad	Presencial	X	Dual
			Virtual
Número de horas con acompañamiento del profesor:	24		Número de horas de trabajo independiente: 72
Fecha de actualización de la guía:	16/03/2023		

2. Conocimientos previos requeridos para el curso
NA

3. Justificación
<p>Las decisiones financieras son eminentemente técnicas. Los análisis y herramientas más importantes del campo financiero se basan en métodos cuantitativos para lograr resultados objetivos que permitan tomar decisiones con argumentos sólidos. Necesariamente el estudio del comportamiento y de la relación de las variables financieras pasa por un fuerte componente estadístico y econométrico. De esta forma, este curso se aborda desde el reconocimiento y la descripción estadística de las variables financieras, el dominio de las distribuciones de probabilidad más frecuentes y el uso de modelos econométricos univariados y multivariados para las aplicaciones más útiles en finanzas corporativas y de inversiones.</p>

4. Competencias de formación		
Id	Competencia	Resultado de aprendizaje esperado
1	Gerencia los recursos financieros de la organización usando técnicas y tendencias financieras para la toma de decisiones de inversión, financiación y operación en el corto y largo plazo	1 - Describe las diferentes distribuciones de probabilidad asociadas a variables financieras y económicas para realizar análisis descriptivo e inferencial. 2 - Estima modelos econométricos para representar la evolución dinámica de las series de tiempo financieras, en sus retornos, con especial énfasis sobre su capacidad de representar las propiedades empíricas de las series reales y predecir su evolución 3 -

5. Contenidos		
Id	Unidad de aprendizaje	Temáticas
1	Estadística Aplicada a Variables Financieras	Variables Aleatorias y Distribuciones de Probabilidad Estadística Inferencial: Intervalos de Confianza y Pruebas de Hipótesis
2	Econometría Financiera	Modelo Clásico de Regresión Lineal Análisis de Tendencias y Estacionalidades Análisis de Series de Tiempo

6. Evaluación y calificación	
Actividades o tipos de actividades	Porcentaje
Talleres en clase	40
Estudios de caso	40
Asistencia	20

7. Bibliografía

Brooks, C. (2008), Introductory Econometrics for Finance. Cambridge University Press, Cambridge. Biblioteca Luis Carlos Galán Sarmiento Gujarati, Damodar (2010) Econometría, 5ª Edición, Ed. McGraw Hill. Apéndices A y B.

Wooldridge, Jeffrey M. (2015) Introducción a la Econometría: Un Enfoque Moderno, 4a Edición, Ed. Thomson Learning. Apéndices B y C

Hilmer, Christiana (2014). Practical econometrics : data collection, analysis and application. Mc GrawHill, NYC.

Fan, Jianqing (2017). The Elements of Financial Econometrics. Cambridge University Press.

Bornet, William (2022). Quantitative Analysis of Social and Financial Market Development. Emerald Pub.

Mercangoz, Burcu (2021). Handbook of Research on Emerging Theories, Models, and Applications of Financial Econometrics. Springer.

Maiti, Moinak (2021). Applied Financial Econometrics: Theory, Method and Applications. Palgrave Macmillan.

Hurn, Stan (2020). Financial Econometric Modeling. oup Usa.

8. Observaciones