

## Programación semanal

En la programación semanal te presentamos un **reparto del trabajo de la asignatura** a lo largo de las semanas del cuatrimestre.

	CONTENIDO TEÓRICO	ACTIVIDADES (15 puntos)	CLASES EN DIRECTO
Semana 1	<b>Tema 1. Distribuciones de probabilidad</b> 1.1. Introducción y objetivos 1.2. Distribuciones de probabilidad discretas 1.3. Distribuciones de probabilidad continuas 1.4. Referencias bibliográficas	<b>Huella UNIR</b> (2,6 puntos)  <b>Test Tema 1</b> (0,1 punto)	Sesión de Presentación de la asignatura  Clase del Tema 1
Semana 2	<b>Tema 2. Inferencia estadística</b> 2.1. Introducción y objetivos 2.2. Conceptos básicos de inferencia estadística y estimación de parámetros 2.3. Propiedades de los estimadores 2.4. Inferencia estadística. Métodos de estimación puntual 2.5. Inferencia estadística. Estimación por intervalos de confianza 2.6. Contraste de hipótesis 2.7. Referencias bibliográficas	<b>Test Tema 2</b> (0,1 punto)	Clase del Tema 2
Semana 3	<b>Tema 3. Teoría de probabilidad</b> 3.1. Introducción y objetivos 3.2. Conceptos básicos de probabilidad. Espacio muestral 3.3. Distribución de frecuencias 3.4. Medidas de posición y dispersión 3.5. Tipificación de variables 3.6. Probabilidad 3.7. Probabilidad condicional 3.8. Independencia de sucesos 3.9. Referencias bibliográficas	<b>Test Tema 3</b> (0,1 punto)	Clase del Tema 3
Semana 4	<b>Tema 4. Análisis bayesiano</b> 4.1. Introducción y objetivos 4.2. Conceptos generales de probabilidad bayesiana 4.3. El teorema de Bayes	<b>Entrega Actividad 1</b> (3 puntos)	Clase del Tema 4
Semana 5	<b>Tema 4. Análisis bayesiano (continuación)</b> 4.4. Redes bayesianas 4.5. Ratio de odds 4.6. Referencias bibliográficas	<b>Test Tema 4</b> (0,1 punto)	Clase del Tema 4

	CONTENIDO TEÓRICO	ACTIVIDADES (15 puntos)	CLASES EN DIRECTO
Semana 6	<b>Tema 5. Correlación</b> 5.1. Introducción y objetivos 5.2. Coeficiente de correlación de Pearson 5.3. Significación del coeficiente de correlación de Pearson 5.4. Interpretación del coeficiente de correlación de Pearson 5.5. Correlación y causalidad 5.6. Referencias bibliográficas	<b>Test</b> Tema 5 (0,1 punto)	<b>Clase de Resolución de la Actividad 1</b>  Clase del Tema 5
Semana 7	<b>Tema 6. Volatilidad</b> 6.1. Introducción y objetivos 6.2. Modelo de suavizado exponencial. EWMA 6.3. Modelo GARCH (1,1) 6.4. Predicción de la volatilidad	<b>Test</b> Tema 6 (0,1 punto)	Clase del Tema 6
Semana 8	<b>Tema 7. Estadística y modelización financiera</b> 7.1. Introducción y objetivos 7.2. Medición del riesgo inherente de los activos y carteras de renta variable 7.3. Medición de las rentabilidades de los activos y carteras de renta variable	<b>Entrega Actividad 2</b> (3 puntos)	Clase del Tema 7
Semana 9	<b>Tema 7. Estadística y modelización financiera (continuación)</b> 7.4. Modelización financiera 7.5. Modelo CAPM 7.6. Modelo VaR (Value at Risk) 7.7. Modelos de valoración multifactoriales	<b>Test</b> Tema7 (0,1 punto)	<b>Sesión de Recomendación de Examen</b>  Clase del Tema 7
Semana 10	<b>Tema 8. Regresión lineal</b> 8.1. Introducción y objetivos 8.2. Regresión lineal simple 8.3. Modelos probit 8.4. Modelos logit 8.5. Regresión lineal con regresores múltiples 8.6. Multicolinealidad de las variables explicativas 8.7. Referencias bibliográficas	<b>Actividad grupal</b> Lectura individual  <b>Test</b> Tema 8 (0,1 punto)	<b>Clase de Resolución de la Actividad 2</b>  Clase del Tema 8
Semana 11		<b>Actividad grupal</b>	<b>Presentación de la Actividad Grupal</b>

	CONTENIDO TEÓRICO	ACTIVIDADES (15 puntos)	CLASES EN DIRECTO
Semana 12	<b>Tema 9. Series temporales</b> 9.1. Introducción y objetivos 9.2. Procesos estocásticos 9.3. Modelos univariantes. ARMA y ARIMA 9.4. Modelos multivariantes estacionarios 9.5. Modelos multivariantes no estacionarios 9.6. Referencias bibliográficas	<b>Test Tema 9</b> (0,1 punto)	Clase del Tema 9
Semana 13		<b>Entrega de Actividad Grupal</b> (5,4 puntos)	<b>Clase de Resolución de Actividad Grupal</b>
Semana 14	<b>Tema 10. Métodos de simulación</b> 10.1. Introducción y objetivos 10.2. Generación de números aleatorios 10.3. Simulación histórica 10.4. Simulación de Montecarlo	<b>Test Tema 10</b> (0,1 punto)	Clase del Tema 10
Semana 15	<b>Clase de Repaso</b>		
Semana 16	<b>Semana de exámenes</b>		

**NOTA**

Esta **Programación semanal** puede ser modificada si el profesor lo considera oportuno para el enriquecimiento de la asignatura.