

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	Tema 1. Distribuciones de probabilidad 1.1. Introducción y objetivos 1.2. Distribuciones de probabilidad discretas 1.3. Distribuciones de probabilidad continuas 1.4. Referencias bibliográficas	Huella UNIR (2,6 puntos) Test Tema 1 (0,1 punto)	Sesión de Presentación de la asignatura Clase del Tema 1
Semana 2	Tema 2. Inferencia estadística 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	Test Tema 2 (0,1 punto)	Clase del Tema 2
Semana 3	Tema 3. Teoría de probabilidad 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	Test Tema 3 (0,1 punto)	Clase del Tema 3
Semana 4	Tema 4. Análisis bayesiano 4.1. Introducción y objetivos 4.2. Conceptos generales de probabilidad bayesiana 4.3. El teorema de Bayes	Entrega Actividad 1 (3 puntos)	Clase del Tema 4
Semana 5	Tema 4. Análisis bayesiano (continuación) 4.4. Redes bayesianas 4.5. Ratio de odds 4.6. Referencias bibliográficas	Test Tema 4 (0,1 punto)	Clase del Tema 4

	CONTENIDO TEÓRICO	ACTIVIDADES (15 puntos)	CLASES EN DIRECTO
Semana 6	Tema 5. Correlación 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	Test Tema 5 (0,1 punto)	Clase de Resolución de la Actividad 1 Clase del Tema 5
Semana 7	Tema 6. Volatilidad 6.1. Introducción y objetivos 6.2. Modelo de suavizado exponencial. EWMA 6.3. Modelo GARCH (1,1) 6.4. Predicción de la volatilidad	Test Tema 6 (0,1 punto)	Clase del Tema 6
Semana 8	Tema 7. Estadística y modelización financiera 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	Entrega Actividad 2 (3 puntos)	Clase del Tema 7
Semana 9	Tema 7. Estadística y modelización financiera (continuación) 7.4. Modelización financiera 7.5. Modelo CAPM 7.6. Modelo VaR (Value at Risk) 7.7. Modelos de valoración multifactoriales	Test Tema7 (0,1 punto)	Sesión de Recomendación de Examen Clase del Tema 7
Semana 10	Tema 8. Regresión lineal 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	Actividad grupal Lectura individual Test Tema 8 (0,1 punto)	Clase de Resolución de la Actividad 2 Clase del Tema 8
Semana 11		Actividad grupal Aula de discusión	Presentación de la Actividad Grupal

CONTENIDO TEÓRICO	ACTIVIDADES (15 puntos)	CLASES EN DIRECTO
Tema 9. Series temporales 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	Test Tema 9 (0,1 punto)	Clase del Tema 9
Semana 13	Entrega de Actividad Grupal (5,4 puntos)	Clase de Resolución de Actividad Grupal
Tema 10. Métodos de simulación 10.1. Introducción y objetivos 10.2. Generación de números aleatorios 10.3. Simulación histórica 10.4. Simulación de Montecarlo	Test Tema 10 (0,1 punto)	Clase del Tema 10
Semana 15	Clase de Repaso	
Semana 16	Semana de exámenes	

NOTA

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