

PROGRAMA DE LA ASIGNATURA

Curso académico: 2013-2014.

Identificación y características de la asignatura					
Código	502356			Créditos ECTS	6
Denominación	Estadística Aplicada a las Finanzas II				
Titulaciones	Grado en Finanzas y Contabilidad				
Centro	Facultad de Estudios Empresariales y Turismo				
Semestre	Séptimo	Carácter	Optativo		
Módulo	Complementos para las Finanzas Cuantitativas				
Materia	Estadística				
Profesor/es					
Nombre	Despacho	Correo-e	Página web		
Cristina Gutiérrez Pérez José Pablo Arias Nicolás	10 5	cgutierrez@unex.es jparias@unex.es	Campus virtual de la asignatura		
Área de conocimiento	Estadística e Investigación Operativa				
Departamento	Matemáticas				
Profesor coordinador (si hay más de uno)	Cristina Gutiérrez Pérez				
Competencias					
Competencias genéricas instrumentales (A1):					
<p>A1.1. Capacidad de análisis y síntesis.</p> <p>A1.2. Conocimientos de informática relativos al ámbito de estudio.</p> <p>A1.3. Capacidad de organización y planificación.</p> <p>A1.4. Capacidad para la resolución de problemas.</p> <p>A1.5. Habilidad para analizar y buscar información proveniente de fuentes diversas.</p> <p>A1.6. Comunicación oral y escrita en la lengua nativa.</p> <p>A1.7. Capacidad de tomar decisiones.</p>					
Competencias genéricas personales (A2):					
<p>A2.1. Capacidad para trabajar en equipo.</p> <p>A2.2. Trabajo en un equipo de carácter interdisciplinar.</p> <p>A2.6. Capacidad crítica y autocrítica.</p> <p>A2.8. Trabajar en entornos de presión.</p>					

Competencias genéricas sistémicas (A3):

- A3.1. Capacidad de aprendizaje autónomo en el ámbito de los conocimientos y las competencias relacionadas con el desempeño de tareas y funciones financieras y contables que le permitan emprender actividades más complejas o continuar el aprendizaje de técnicas propias de especialista en el área de las finanzas y la contabilidad.
- A3.2. Capacidad de adaptación a nuevas situaciones y circunstancias a consecuencia de las cuales se han de proponer actuaciones y tomar decisiones con agilidad y espíritu crítico.
- A3.4. Liderar, defender, argumentar y proponer opiniones y actuaciones en pos de la resolución de problemas relacionados con la dirección y la gestión.
- A3.7. Sensibilidad hacia temas medioambientales y sociales, siendo capaz de reconocer y abordar estas cuestiones de manera apropiada.

Competencias específicas del Título (CE):

- CE02/0 Localizar y procesar información económico-financiera relevante en las empresas e instituciones.
- CE02/1 Analizar, sintetizar y elaborar conclusiones técnicas propias de profesionales del ámbito de las finanzas y la contabilidad, derivando, interpretando y evacuando documentos e informes útiles para la toma de decisiones por terceros.
- CE03 Conocer y aplicar criterios e instrumentos técnicos en la resolución de problemas relacionados con las finanzas y la contabilidad; emitiendo informes y asesorando a los sujetos interesados.
- CE04 Conocer la estructura de los mercados financieros, los productos negociados en ellos y el papel de los agentes participantes.

Competencias específicas del Módulo Optativo Complementos para las Finanzas Cuantitativas

- M9/01.- Resolver situaciones y problemas en el ámbito de las finanzas y contabilidad con criterios profesionales y con rigor.
- M9/02.- Elaborar y redactar informes técnicos sobre mercados y sectores relevantes para la toma de decisiones en empresas e instituciones financieras.
- M9/03.- Comprender la naturaleza de la empresa e instituciones financieras y su relación con el entorno socioeconómico.
- M9/07.- Conocer los objetivos básicos del análisis cualitativo y su utilización en la identificación de relaciones entre magnitudes financieras y contables.
- M9/12.- Evaluar y prever la evolución de sucesos, fenómenos variables relacionados con empresas e instituciones en el contexto socioeconómico para la toma de decisiones.

Temas y contenidos

Breve descripción del contenido

Conocer las técnicas estadísticas básicas para el tratamiento de datos y situaciones reales relacionadas con los mercados financieros, la información financiero-contable y los inversores utilizando las herramientas informáticas más usuales en el análisis de la varianza, el modelo lineal general, univariantes y multivariantes y la clasificación y asignación de datos a grupos en función de sus características.

Programa teórico

- Tema 1: Componentes Principales.
- Tema 2: Clasificación de datos.
- Tema 3: Modelos Lineales Generalizados.
- Tema 4: Análisis de la varianza.

Actividades formativas

Horas de trabajo del alumno por tema		Presencial		Actividad de seguimiento	No presencial
Tema	Total	GG	SL	TP	EP
Tema 1	27	8	4	1.5	15
Tema 2	43	12	6	2	25
Tema 3	42	9	3	2	30
Tema 4	34	12	2	2	20
Evaluación del conjunto	4	4	0		
Total	150	45	15		90

GG: Grupo Grande (100 estudiantes).

SL: Seminario/Laboratorio (prácticas clínicas hospitalarias = 7 estudiantes; prácticas laboratorio o campo = 15; prácticas sala ordenador o laboratorio de idiomas = 30, clases problemas o seminarios o casos prácticos = 40).

TP: Tutorías Programadas (seguimiento docente, tipo tutorías ECTS).

EP: Estudio personal, trabajos individuales o en grupo, y lectura de bibliografía.

Metodología

Las clases se impartirán mediante el uso de ordenadores. Se introducirá al alumno en la utilización de ordenadores para resolver problemas científicos y se utilizará el paquete estadístico R para resolver problemas reales que surgen en el campo de las finanzas y la contabilidad.

Sistemas de evaluación

Evaluación Continua de las Actividades Prácticas:

La valoración del trabajo a desarrollar a lo largo del curso permite evaluar las competencias asociadas al mismo como el reparto de responsabilidades y tareas dentro de los grupo de trabajo, la capacidad de análisis y síntesis y la interpretación y conocimiento de la realidad, la búsqueda y selección de información procedente de diferentes fuentes, la expresión escrita y la argumentación de ideas.

Se establece un margen medio (distribuido entre asistencia y participación activa y realización de ejercicios, trabajos y casos) en el módulo del 30 al 40% de peso sobre la evaluación total.

Examen:

Permite evaluar la adquisición de competencias asociadas al módulo: la aplicación de conocimientos adquiridos previamente, la evaluación de las consecuencias de distintas alternativas de acción y el manejo de instrumentos. Los exámenes se realizan al finalizar cada bloque y permiten evaluar los conocimientos teórico/prácticos adquiridos, según la ficha de la asignatura correspondiente en este modulo donde se fijará el tipo de examen y valorar si se cumplen los objetivos planteados en relación a los mismos. Se establece un margen medio en el módulo del 60 al 70% de peso sobre la evaluación total.

Se aplicará el sistema de calificaciones vigente en cada momento; actualmente, el que aparece en el RD 1125/2003, artículo 5º. Los resultados obtenidos por el alumno en cada una de las materias del plan de estudios se calificarán en función de la siguiente escala numérica de 0 a 10, con expresión de un decimal, a la que podrá añadirse su correspondiente calificación cualitativa: 0 - 4,9: Suspenso (SS), 5,0 - 6,9: Aprobado (AP), 7,0 - 8,9: Notable (NT), 9,0 - 10: Sobresaliente (SB). La mención de Matrícula de Honor podrá ser otorgada a alumnos que hayan obtenido una calificación igual o superior a 9.0. Su número no podrá exceder del 5 % de los alumnos matriculados en una asignatura en el correspondiente curso académico, salvo que el número de alumnos matriculados sea inferior a 20, en cuyo caso se podrá conceder una sola Matrícula de Honor.

Bibliografía y otros recursos

Cuadras, C. M. (1991) *Métodos de Análisis Multivariante* (2ª ed.). PPU.

Friedman J., Hastie T., and Tibshirani R. (2009), *The Elements of Statistical Learning*. Springer, Berlin, 2 edition.

Johnson, R. A. y Wichern, D. W. (1998) *Applied Multivariate Statistical Analysis* (4ª ed.). Prentice Hall.

Levy Mangin J. P., Várela Mallou J. (2003), *Análisis Multivariable para las Ciencias Sociales*, Prentice Hall, Pearson Educación S.A.

Peña, D. (2003), *Análisis de datos multivariantes*. Ed. McGraw Hill.

Uriel, E. y Aldás, J. (2005): *Análisis multivariante aplicado*. Ed. Thomson.

Otros recursos. Páginas web.

<http://www.r-project.org/> Página principal del software R.

<http://cran.r-project.org/doc/contrib/R-intro-1.1.0-espanol.1.pdf> Manual básico en español para iniciarse en el manejo del R.

Horario de tutorías

CRISTINA GUTIÉRREZ PÉREZ

Tutorías (Primer Semestre)

	Horario	Lugar
Martes	17:00 – 19:00	Despacho 10
Miércoles	10:30 – 12:30	Despacho 10
Jueves	10:30 – 12:30	Despacho 10

Tutorías (Segundo Semestre)

	Horario	Lugar
Martes	18:00 – 20:00	Despacho 10
Miércoles	10:00 – 12:00	Despacho 10
Jueves	16:00 – 18:00	Despacho 10

Tutorías Periodo de Exámenes

	Horario	Lugar
Martes	10:00 – 12:00	Despacho 10
Miércoles	17:00 – 19:00	Despacho 10
Jueves	10:00 – 12:00	Despacho 10

Tutorías Periodo No Lectivo

	Horario	Lugar
Lunes	17:00 – 20:00	Despacho 10
Martes	10:00 – 13:00	Despacho 10

- El horario de tutorías puede sufrir modificaciones a partir de las disponibilidades horarias para teoría y prácticas. En cualquier caso, el horario definitivo, que será aprobado por Consejo de Departamento, se anunciará en la puerta del despacho citado arriba, en la clase de presentación, en el Campus Virtual y a través del correo electrónico para todos los alumnos matriculados.

Tutorías (Primer Semestre)

	Horario	Lugar
Martes	17:00 – 19:00	Despacho 5
Miércoles	10:30 – 12:30	Despacho 5
Jueves	10:30 – 12:30	Despacho 5

Tutorías (Segundo Semestre)

	Horario	Lugar
Martes	17:30 – 19:30	Despacho 5
Miércoles	10:00 – 12:00	Despacho 5
Jueves	10:00 – 12:00	Despacho 5

Tutorías Periodo No Lectivo

	Horario	Lugar
Martes	10:00 – 13:00	Despacho 5
Miércoles	17:00 – 20:00	Despacho 5

- El horario de tutorías puede sufrir modificaciones a partir de las disponibilidades horarias para teoría y prácticas. En cualquier caso, el horario definitivo, que será aprobado por Consejo de Departamento, se anunciará en la puerta del despacho citado arriba, en la clase de presentación, en el Campus Virtual y a través del correo electrónico para todos los alumnos matriculados.

Recomendaciones

Conocimientos previos:

- Conocimientos matemáticos básicos: sumatorios, operaciones con matrices, derivación e integración.
- Conocimientos estadísticos básicos: distribuciones de frecuencia, conceptos básicos de probabilidad, variables aleatorias, distribuciones de probabilidad.

Estudio de la asignatura:

- Se recomienda al alumno llevar al día la asignatura y realizar todos los ejercicios en el periodo recomendado por el profesor, así como consultar con el profesor todas las dudas que se planteen tanto en el horario de tutorías como en el transcurso de las clases.

Revisión de prueba de evaluación:

- Se seguirá un procedimiento consistente en la revisión y discusión con el profesor de las distintas pruebas de evaluación realizadas.