

GUÍA DOCENTE

1. DESCRIPCIÓN DE LA ASIGNATURA

Grado:	Finanzas y Contabilidad
Doble Grado:	Derecho y Finanzas y Contabilidad
Asignatura:	ESTADÍSTICA PARA FINANZAS II
Módulo:	Módulo II: Ampliación de Economía y Estadística
Departamento:	Economía, Métodos Cuantitativos e Historia Económica
Semestre:	1^{er} semestre
Créditos totales:	6
Curso:	3^o
Carácter:	Obligatoria
Lengua de impartición:	Español

Modelo de docencia:	C1	
a. Enseñanzas Básicas (EB):		50%
b. Enseñanzas de Prácticas y Desarrollo (EPD):		50%
c. Actividades Dirigidas (AD):		

GUÍA DOCENTE

2. RESPONSABLE DE LA ASIGNATURA

Responsable 1 de las asignatura	
Nombre:	Alfredo García Hernández-Díaz
Centro:	Facultad de Ciencias Empresariales
Departamento:	Economía, Métodos Cuantativos e Historia Económica
Área:	Métodos Cuantativos
Categoría:	Profesor Titular de Universidad
Horario de tutorías:	
Número de despacho:	3.3.6
E-mail:	agarher@upo.es
Teléfono:	954 34 8379

Responsable 2 de las asignatura	
Nombre:	María Manuel Segovia González
Centro:	Facultad de Ciencias Empresariales
Departamento:	Economía, Métodos Cuantativos e Historia Económica
Área:	Métodos Cuantitativos
Categoría:	Contratado Doctor
Horario de tutorías:	
Número de despacho:	3.2.23
E-mail:	mmseggon@upo.es
Teléfono:	954349741

GUÍA DOCENTE

3. UBICACIÓN EN EL PLAN FORMATIVO

3.1. Descripción de los objetivos

- Iniciar al alumno en las técnicas estadísticas de análisis de datos.
- Que el alumno maneje el software informático aplicado al campo de la estadística.
- Que el alumno visualice la aplicabilidad de estas técnicas a la realidad económico-empresarial.
- Fomentar el trabajo en grupo.
- Que el alumno adquiera capacidad autónoma para resolver problemas inherentes al desarrollo profesional de la titulación.
- Fomentar la capacidad crítica sobre la conveniencia en la utilización de determinados recursos estadísticos para la correcta interpretación de la realidad económica y empresarial.
- Entrenar la capacidad de análisis, síntesis, manejo de vocabulario específico y presentación de resultados.

3.2. Aportaciones al plan formativo

- Aporta las herramientas y crea las bases para el análisis econométrico de la realidad económico-empresarial.
- Es la base instrumental de otras materias más específicas que manejen técnicas estadísticas o econométricas.

3.3. Recomendaciones o conocimientos previos requeridos

Se recomienda haber cursado Estadística para finanzas I.

GUÍA DOCENTE

4. COMPETENCIAS

4.1 Competencias de la Titulación que se desarrollan en la asignatura

- Competencias específicas:

- Conocer y aplicar los conceptos básicos de Inferencia Estadística e interpretar sus resultados

- Competencias generales:

Competencias sistémicas:

- Actuar de acuerdo con criterios de responsabilidad social, principios de igualdad de oportunidades entre hombres y mujeres, principios de igualdad de oportunidades y accesibilidad universal de las personas con discapacidad y los valores propios de una cultura de la paz y de valores democráticos.
- Sensibilidad hacia temas ambientales y sociales.
- Capacidad de aprendizaje autónomo.
- Capacidad de adaptación a nuevas situaciones.
- Creatividad.
- Liderazgo.
- Iniciativa y espíritu emprendedor.
- Motivación por la calidad.

Personales :

- Capacidad para trabajar en equipo.
- Habilidad en las relaciones personales.
- Capacidad crítica y autocrítica.
- Compromiso ético en el trabajo.
- Trabajar en entornos de presión.

Instrumentales:

- Capacidad de análisis y síntesis.
- Capacidad de organización y planificación.
- Comunicación oral y escrita en castellano.
- Comunicación oral y escrita en una lengua extranjera (para el Grado en inglés).
- Conocimientos de informática relativos al ámbito de estudio.
- Habilidad para analizar y buscar información proveniente de fuentes diversas.
- Capacidad para la resolución de problemas.
- Capacidad para tomar decisiones.

4.2. Competencias del Módulo que se desarrollan en la asignatura

Modulo II: AMPLIACIÓN DE ECONOMÍA Y ESTADÍSTICA.

- Competencias específicas:

- Conocer y aplicar los conceptos básicos de Inferencia Estadística e interpretar sus resultados

GUÍA DOCENTE

- Competencias generales:

Competencias sistémicas:

- Actuar de acuerdo con criterios de responsabilidad social, principios de igualdad de oportunidades entre hombres y mujeres, principios de igualdad de oportunidades y accesibilidad universal de las personas con discapacidad y los valores propios de una cultura de la paz y de valores democráticos.
- Sensibilidad hacia temas ambientales y sociales.
- Capacidad de aprendizaje autónomo.
- Capacidad de adaptación a nuevas situaciones.
- Creatividad.
- Liderazgo.
- Iniciativa y espíritu emprendedor.
- Motivación por la calidad.

Personales :

- Capacidad para trabajar en equipo.
- Habilidad en las relaciones personales.
- Capacidad crítica y autocrítica.
- Compromiso ético en el trabajo.
- Trabajar en entornos de presión.

Instrumentales:

- Capacidad de análisis y síntesis.
- Capacidad de organización y planificación.
- Comunicación oral y escrita en castellano.
- Conocimientos de informática relativos al ámbito de estudio.
- Habilidad para analizar y buscar información proveniente de fuentes diversas.
- Capacidad para la resolución de problemas.
- Capacidad para tomar decisiones.

4.3. Competencias particulares de la asignatura

Conocer y aplicar los conceptos básicos del análisis de datos en Estadística para Finanzas.

GUÍA DOCENTE

5. CONTENIDOS DE LA ASIGNATURA (TEMARIO)

Tema 1: Modelos probabilísticos.

- a) Modelos probabilísticos de variables aleatorias de tipo discreto: Bernoulli, binomial y Poisson.
- b) Modelos probabilísticos de variables aleatorias de tipo continuo: modelo normal. Modelos probabilísticos asociados a la normal: ji-cuadrado de Pearson, t de Student y F de Fisher-Snedecor.

Tema 2: Distribuciones en el muestreo

- a) Muestra aleatoria. Parámetros poblacionales y estadísticos muestrales.
- b) Distribución muestral de estadísticos.
- c) Media y varianza de algunos estadísticos.
- d) Distribución de estadísticos muestrales de poblaciones normales.
- e) Distribución de la proporción muestral.
- f) Distribución de la diferencia de proporciones.

Tema 3: Estimación Puntual

- a) Introducción a la Inferencia Estadística.
- b) El problema de la estimación: estimación puntual.
- c) Propiedades de los estimadores puntuales.
- d) Obtención de estimadores: método de los momentos, método de la Máxima verosimilitud.

Tema 4: Estimación por intervalos

- a) Construcción de intervalos de confianza.
- b) Intervalos de confianza en poblaciones normales.
- c) Intervalos de confianza en poblaciones no necesariamente normales.

Tema 5: Contrastes de hipótesis

- a) Concepto y tipos de hipótesis.
- b) Región crítica y región de aceptación.
- c) Tipos de errores.
- d) Fases a seguir en un test de hipótesis.
- e) Potencia y función de potencia del contraste.

Tema 6. Contrastes paramétricos

Tema 7. Contrastes no paramétricos.

GUÍA DOCENTE

6. METODOLOGÍA Y RECURSOS

- Enseñanzas Básicas (gran grupo: 60 alumnos): 15 sesiones (22'5h.)
Exposición de los aspectos teóricos básicos de la asignatura a través de clases magistrales, conferencias, presentación de trabajos (si procede) y demás actividades presenciales susceptibles de desarrollarse en grupos grandes.

- Enseñanzas de prácticas y desarrollo (3 grupos de 20 alumnos): 15 sesiones (22'5h.)
Se resolverán problemas como complemento práctico a los contenidos desarrollados en el Gran Grupo. En estas sesiones es aconsejable un trabajo personal previo y deben dedicarse a resolver dudas y a que el alumno presente problemas previamente trabajados. Además incluye prácticas de informática en clases presenciales con ordenador para el conocimiento y familiarización por parte del alumno del software específico (SPSS, MS Excel).

- Estudio personal del alumno: 100h.

- Evaluación: 5h.

- Nota: El cronograma se adjuntará en la guía específica.

GUÍA DOCENTE

7. EVALUACIÓN

- Evaluación continua:

Se realizarán controles periódicos (test y problema en los últimos 15-20 minutos de una sesión de EPD) que evalúen el progreso del alumno y se podrán realizar trabajos individuales o en grupo. Esta parte supone un 30% de la nota final.

- Prácticas de informática:

Se realizarán 4 prácticas de informática manejando los paquetes informáticos estadístico/económicos SPSS. En las 3 primeras se plantearán ejercicios de evaluación para resolver en grupo. La 4ª se plantea exclusivamente con el objetivo de demostrar, individualmente, el progreso adecuado mediante ejercicios de evaluación semejantes a los realizados en las 3 primeras. Esta parte supone el 20% de la nota final.

- Prueba final: Se realizará una prueba escrita al final del semestre, que constará de preguntas teóricas y problemas relacionados con la asignatura pretendiéndose con ello que el alumno demuestre haber adquirido las competencias trabajadas. Dicha prueba supone el 50% restante de la nota total.

Puntuaciones mínimas:

Prueba final: 1,75 puntos de los 5 posibles

Prácticas de informática: 1 punto de los 2 posibles

- Convocatoria de Recuperación (Segunda convoc en junio/julio):

A los alumnos que no superen la asignatura según el sistema de evaluación descrito se les realizará una segunda prueba en junio o julio. En ella se evaluarán obligatoriamente de nuevo las enseñanzas básicas (50%). Además, se permitirá una recuperación de las prácticas de informática evaluadas (20%) para aquellos alumnos que no las superaron.

El alumno podrá optar a ser evaluado sobre el 100% de la calificación por alguno de los siguientes dos motivos:

1. Mediante la consideración del 30% correspondiente a la evaluación continua obtenida durante el curso;
2. Mediante una prueba de evaluación adicional con un peso del 30% correspondiente a la evaluación continua, renunciando expresamente a la calificación obtenida durante el curso y comunicándolo con al menos 10 días de antelación a la prueba al profesor responsable de la asignatura.

GUÍA DOCENTE

8. BIBLIOGRAFÍA GENERAL

- CAMACHO, J. (2002). Estadística con SPSS para Windows. Ed. Ra-Ma.
- CASAS SÁNCHEZ, J.M. (1997). “Inferencia Estadística”. Ed. CEURA. Madrid.
- CASAS SÁNCHEZ, J.M. y otros (1998). “Problemas de Estadística”. Ed. Pirámide.
- IPIÑA, S.L.; DURAND, A.I. (2008) “Inferencia Estadística y Análisis de Datos”. Ed. Prentice Hill
- KAZMIER, J. (1998). “Estadística Aplicada a la Administración y a la Economía”. Ed. McGraw Hill. México.
- LEVY, J.P.; VARELA, J. (2003). “Análisis Multivariante para las Ciencias Sociales”. Ed. Prentice Hall. Madrid.
- NEWBOLD, P. (1998). “Estadística para los negocios y la economía”. Ed. Prentice Hall.
- PARDO, A., RUIZ, M.A. (2005). “Análisis de Datos con SPSS 13 Base”. Ed. McGraw Hill. Madrid.
- PEÑA, D. (2002). “Análisis de Datos Multivariantes”. Ed. McGraw Hill. Madrid.
- PÉREZ, C. (2001). Técnicas Estadísticas con SPSS. Ed. Prentice Hall.
- URIEL, E.; MUÑIZ, M. (1988). “Estadística Económica y Empresarial. Teoría y Ejercicios”. Ed. AC. Madrid.
- VISAUTA VINACUA, B. (2002). “Análisis estadístico con SPSS para Windows”. Ed. McGrawHill.