

**1. Horario atención a estudiantes, correos electrónicos y nombres de los profesores complementarios**

**Clase magistral**

Profesor: Jose Eduardo Gomez Gonzalez ([jgomezgo@banrep.gov.co](mailto:jgomezgo@banrep.gov.co))

Horario de atención a estudiantes: Miércoles, 2 – 5 pm

Lugar de atención a estudiantes: Banco de la República, edificio principal, piso 11

Profesor asistente / complementario / monitor: Nombres y correo

Horario de atención a estudiantes:

Lugar de atención a estudiantes:

**2. Introducción y descripción general del curso**

La econometría financiera es la intersección de las finanzas y técnicas estadísticas.

Busca evaluar modelos que pretenden explicar el funcionamiento de los mercados financieros y la determinación de precios en dichos mercados.

En este curso se introducirán las técnicas estadísticas más adecuadas para estudiar modelos usando datos financieros.

**3. Objetivos de la materia**

Introducir a los estudiantes en el manejo de diversas técnicas y metodologías de econometría financiera que les serán útiles para elaborar tesis de grado y para trabajar en instituciones financieras en el país y en el exterior.

**4. Organización del curso**

1. Retornos de activos financieros y su predicción. Modelos univariados.
2. Riesgo de activos financieros (volatilidad) y su predicción. Modelos univariados.
3. Estudio y predicción de los retornos y los riesgos para portafolio de activos. Modelos multivariados.
4. Paseos aleatorios y cointegración en el estudio de series financieras.
5. Riesgo de mercado: modelos VaR y C-VaR.
6. Modelos de datos de cuenta y modelos de duración en el estudio de series y modelos financieros.

**5. Metodología**

Presentación magistral de los temas por parte del profesor. Desarrollo de proyecto dirigido por parte de los estudiantes y presentación de los mismos.

**6. Competencias** (Escriba 2 o 3 competencias que Ud. podría comprometerse a desarrollar en este curso)

Al finalizar el curso el estudiante debe estar familiarizado con técnicas frecuentemente utilizadas para estudiar series y mercados financieros desde el punto de vista económico y estadístico.

Al finalizar el curso el estudiante habrá desarrollado un trabajo que le servirá como artículo publicable en el futuro cercano.

**7. Criterios de evaluación (Porcentajes de cada evaluación)**

No se controlará asistencia. Sin embargo, se espera que los estudiantes participen activamente del curso.

La nota final se calculará así: 30% examen parcial, 30% examen final, 20% presentación anteproyecto, 20% presentación final del proyecto.

**8. Sistema de aproximación de notas definitiva**

Se seguirá el sistema tradicional de la universidad. Notas posibles del curso: 1.5, 2.0, 2.5, 3.0, 3.5, 4.0, 4.5 y 5.0

**9. Bibliografía**

Varios artículos que se anunciarán cuando sea oportuno.