

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:	2º semestre/ 1er semestre
Créditos totales:	6
Curso:	2º / 3º
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 1º de las asignatura	
Nombre:	Alfredo García Hernández-Díaz
Centro:	Facultad de Ciencias Empresariales
Departamento:	Economía, Métodos Cuantitativos e Historia Económica
Área:	Métodos Cuantitativos
Categoría:	Profesor Titular de Universidad
Horario de tutorías:	Por determinar
Número de despacho:	3.3.6
E-mail:	agarher@upo.es
Teléfono:	954 34 8379

Responsable 2º de las asignatura	
Nombre:	María Manuela Segovia González
Centro:	Facultad de Ciencias Empresariales
Departamento:	Economía, Métodos Cuantitativos e Historia Económica
Área:	Métodos Cuantitativos
Categoría:	Contratado Doctor
Horario de tutorías:	Por determinar
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.

No obstante, de acuerdo con el **artículo 7.3** de la Normativa de Evaluación de los Estudiantes de Grado de la Universidad Pablo de Olavide: *el estudiante que por estar incurso en un programa de movilidad o en un programa de deportistas de alto nivel, por razones laborales, de salud graves, o por causas de fuerza mayor debidamente acreditadas, no haya realizado las pruebas de evaluación continua, tendrá derecho a que en la convocatoria de curso se le evalúe del total de los conocimientos y*

GUÍA DOCENTE

competencias que figuran en la guía docente mediante un sistema de evaluación de prueba única definido en el art. 5.4 de esta normativa. Esta circunstancia deberá ser comunicada al profesor responsable de la asignatura antes del fin del periodo docencia presencial.

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.