

Anexo I. Registro del Título del Trabajo Fin de Grado (TFG)

NOMBRE DEL ALUMNO: Jaime Alonso Rodriguez

PROGRAMA: MII + ADE

GRUPO: 7º

FECHA: 18/06/2024

Director Asignado: López Gómez

Apellidos

Miguel Ángel

Nombre

Título provisional del TFG:

Los índices bursátiles internacionales y su impacto en el precio de cotización de las acciones

ADJUNTAR PROPUESTA (máximo 2 páginas: objetivo, bibliografía, metodología e índice preliminares)

Firma del estudiante:

Fecha:

Título

Los índices bursátiles internacionales y su impacto en el precio de cotización de las acciones

Descripción

Se trata de analizar como influyen los índices bursátiles internacionales en el precio de cotización de las acciones. Se estudiará si los efectos de la inclusión o expulsión de las acciones en los índices bursátiles internacionales. El estudio se realizará a partir de un estudio cuantitativo a partir de la sencilla técnica de estudio de eventos.

Objetivos:

- Entender la magnitud cuantitativa del impacto, tanto en valor financiero como en tiempo afectado, de eventos externos indirectamente relacionados con la inclusión o expulsión de sus valores de un índice bursátil
- Descubrir qué otros parámetros o variables (determinados en el momento del evento) dentro de la empresa, sector, o el mercado afectan cuantitativamente la dinámica del cambio.

Metodología

La principal metodología a utilizar será el estudio de eventos (event study), una técnica que permite analizar el impacto de eventos discretos sobre la evolución de una variable continua en el tiempo. Por ende, se da por hecho que la metodología del proyecto será fundamentalmente cuantitativa.

A grandes rasgos, esta metodología consiste en analizar los datos de la variable a medir en un periodo de tiempo antes del evento o serie de eventos, marcándolo como un “periodo base”, y datos en un periodo de tiempo relevante después del evento, realizando una comparativa estadística entre estos dos conjuntos que permita analizar el impacto específico de los eventos sobre la serie numérica en el eje temporal.

Bibliografía preliminar

Armitage, S. (1995). EVENT STUDY METHODS AND EVIDENCE ON THEIR PERFORMANCE. *Journal Of Economic Surveys*, 9(1), 25-52.
<https://doi.org/10.1111/j.1467-6419.1995.tb00109.x>

De Jong, F., Kemna, A., & Kloek, T. (1992). A contribution to event study methodology with an application to the Dutch stock market. *Journal Of Banking & Finance*, 16(1), 11-36. [https://doi.org/10.1016/0378-4266\(92\)90076-c](https://doi.org/10.1016/0378-4266(92)90076-c)

Eden, L., Miller, S. R., Khan, S., Weiner, R. J., & Li, D. (2022). The event study in international business research: Opportunities, challenges, and practical solutions. *Journal Of International Business Studies*, 53(5), 803-817.
<https://doi.org/10.1057/s41267-022-00509-7>

Kothari, S., & Warner, J. B. (2007). Econometrics of Event Studies**We thank Espen Eckbo, Jon Lewellen, Adam Kolasinski, and Jay Ritter for insightful comments, and Irfan Safdar and Alan Wancier for research assistance. En *Elsevier eBooks* (pp. 3-36).
<https://doi.org/10.1016/b978-0-444-53265-7.50015-9>

Mackinlay, A. C. (1997). Event Studies in Economics and Finance. *Journal Of Economic Literature*, 35(1), 13-39. <https://www.jstor.org/stable/2729691>

Pandey, D. K., & Kumari, V. (2021). Event study on the reaction of the developed and emerging stock markets to the 2019-nCoV outbreak. *International Review Of Economics & Finance*, 71, 467-483. <https://doi.org/10.1016/j.iref.2020.09.014>

Whittington, G., B. Del Brío González, E., Farinós Viñas, J. E., García, C. J., & Ibáñez, A. M. (2009). *Manual práctico sobre estudios de eventos*. Universidad de Salamanca.
http://campus.usal.es/~empresa/09_master/pdf/publicaciones/dt_12_09.pdf

Índice preliminar

1. Introducción
2. Objetivos
3. Metodología
4. Marco teórico
 - 4.1. Estudio de eventos
 - 4.2. Impacto de eventos en la cotización bursátil

5. Resultados

5.1. Análisis estadístico

5.2. Valoración de resultados

6. Conclusión

7. Limitaciones del estudio y futuras investigaciones