

Curso Académico: (2020 / 2021)

Fecha de revisión: 01-07-2020

Departamento asignado a la asignatura: Departamento de Economía

Coordinador/a: GONZALO MUÑOZ, JESUS

Tipo: Obligatoria Créditos ECTS : 6.0

Curso : 4 Cuatrimestre : 1

OBJETIVOS

El objetivo de curso es comprender la evolución temporal de las variables económicas más relevantes (PIB, desempleo, inflación, tipos de interés, tipo de cambio, precios de activos financieros, etc.) y el análisis de las relaciones dinámicas causales existentes entre dichas variables con el propósito de realizar predicciones y llevar a cabo análisis de políticas económicas.

Para lograr este objetivo el alumno debe adquirir una serie de conocimientos, capacidades (específicas y generales) y actitudes

Conocimientos: Al final del curso el estudiante será capaz de:

- Construir modelos adecuados para realizar predicciones
- Construir modelos adecuados para analizar las relaciones causales dinámicas entre variables económicas.
- Analizar el crecimiento de las variables económicas y sus relaciones de largo plazo.

En términos de preguntas concretas, el estudiante aprenderá a responder de forma cuantitativa y sintética, vía un proyecto empírico, a preguntas del tipo:

- Cómo influyen los tipos de interés en el crecimiento económico, nivel de empleo, precios, etc.?
- Cómo influye el crecimiento económico en los niveles de CO₂ y éstos en la temperatura?
- Se pueden predecir los rendimientos de activos financieros?

Competencias específicas: El alumno al finalizar el curso será capaz de:

- Aislar y analizar las características principales de la evolución temporal de los datos económicos.
- Distinguir los diferentes tipos de datos y los componentes de una serie temporal.
- Construir modelos adecuados para el contraste de hipótesis económicas y para la predicción.
- Realizar análisis de causalidad entre variables económicas.
- Evaluar y criticar diferentes enfoques para tratar un problema práctico.

Competencias generales o destrezas:

- Capacidad para resolver problemas complejos.
- Capacidad para discriminar la información relevante contenida en los datos económicos.
- Capacidad para seleccionar el mejor modelo entre un conjunto de modelos alternativos.
- Capacidad de utilización de programas informáticos de modelización econométrica.
- Capacidad de análisis y síntesis.
- Trabajo en equipo.
- Comunicación oral, escrita y gráfica.

Actitudes:

- Actitud crítica sobre las soluciones y modelos aportados por otros.
- Actitud constructiva en base a información o ideas parciales.

DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS: PROGRAMA

En este curso se desarrollan los modelos econométricos básicos para el análisis de datos de series temporales, su predicción y el estudio de relaciones dinámicas causales entre variables económicas.

Los contenidos fundamentales del curso son:

- Características de los datos económicos de series temporales.

- ## ACTIVIDADES FORMATIVAS, METODOLOGÍA A UTILIZAR Y RÉGIMEN DE TUTORÍAS

SISTEMA DE EVALUACIÓN

Página 2 de 3

BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA

- Aznar, A. y F.J. Trivez Métodos de Predicción en Economía (vols 1 y 2), Ariel.
- Diebold, F. Elements of Forecasting (segunda edición), South-Western.
- Koop, G. Analysis of Economic Data, John Wiley.
- Mills, T.C. The Econometric Modelling of Financial Time Series, Cambridge UP.
- Otero, J.M. Econometría (Series Temporales y Predicción), AC.
- Perez, C Econometría de las Series Temporales, Pearson Prentice.
- Perez, C Problemas Resueltos de Econometría, Thompson.
- Peña, D Análisis de Series Temporales, Alianza Editorial.

RECURSOS ELECTRÓNICOS BÁSICOS

- enlace . web: <http://www.eco.uc3m.es/~jgonzalo/teaching/TecnicasEconometricas.html>