

Curso Académico: (2023 / 2024)

Fecha de revisión: 10-05-2022

Departamento asignado a la asignatura: Departamento de Economía

Coordinador/a: GONZALO MUÑOZ, JESUS

Tipo: Obligatoria Créditos ECTS : 3.0

Curso : 1 Cuatrimestre : 1

REQUISITOS (ASIGNATURAS O MATERIAS CUYO CONOCIMIENTO SE PRESUPONE)

Introducción a la Econometría

OBJETIVOS

- Comprensión de las principales características de las series temporales: tendencia, estacionalidad, dependencia temporal estacionaria e innovaciones.
- Modelos que se pueden formular sobre series temporales económicas e históricas: a) univariantes deterministas y ARIMA, b) uniecuacionales dinámicos con variables explicativas exógenas, c) multiecuacionales (VAR) sobre transformaciones estacionarias de las series y d) uniecuacionales y multiecuacionales sobre series con relaciones de cointegración entre sí.
- Metodología para la construcción de los modelos anteriores.
- Aprender la aplicación de todo lo anterior sobre series reales económicas e históricas tanto españolas y europeas, utilizando software específico.

DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS: PROGRAMA

- Descripción de las características empíricas de las series temporales.
- Transformaciones de estacionariedad
- La función de autocorrelación
- Modelos ARIMA estacionales multiplicativos: propiedades
- Estimación, diagnóstico y predicción
- Modelos de series temporales multivariantes
- Modelos multivariantes con variables exógenas: modelos uniecuacionales
- Cointegración

ACTIVIDADES FORMATIVAS, METODOLOGÍA A UTILIZAR Y RÉGIMEN DE TUTORÍAS

Adquisición de conocimientos teóricos a través de:

- Clases magistrales en las que se desarrollara los conceptos teóricos y prácticos fundamentales que el alumno debe adquirir. Para ello se elaborara una colección apuntes y ejercicios que el alumno tendrá con antelación a las clases. Así mismo se facilitará la bibliografía de referencia, complementaria y adicional a los aspectos desarrollados en clase que se pondrá a disposición del alumno para profundizar en aquellos temas en los cuales estén más interesados.
- Resolución de ejercicios y supuestos aplicados por parte del profesor, fomentando la participación activa de los estudiantes en la resolución de los mismos (tanto de forma individual como en equipo). Estos ejercicios se resolverán durante las clases magistrales.

Adquisición de habilidades y destrezas a través de:

- A lo largo del curso se acudirá a las aulas informáticas para introducir al alumno las herramientas informáticas de programación aplicadas a la resolución de problemas directamente relacionados con los contenidos de la asignatura.
- Resolución por parte del alumno de ejercicios propuestos por el profesor que serán entregados a lo largo del curso y que servirán para autoevaluar sus conocimientos y adquirir las capacidades necesarias.
- Elaboración de un proyecto empírico sobre modelos VAR.

SISTEMA DE EVALUACIÓN

El curso esta dividido en dos partes:

En la Primera Parte (50%), la evaluación formativa conformará el 40% de la calificación final. Se llevará a cabo a través de:

- Participación en clase: 20%. Se valorarán las intervenciones concisas, que conecten con las ideas que se han estado exponiendo y que aporten valor añadido a la discusión. A tal fin, el profesor

pondrá en debate una cuestión teórica, un presupuesto, un supuesto práctico, etc.

- Resolución de ejercicios: 20%. Se presentarán al profesor en los momentos establecidos. El profesor los devolverá corregidos y comentados. Normalmente, estos ejercicios se tendrán que hacer individualmente.

El examen final supondrá el resto de la calificación (60%). Constará de un examen escrito teórico y práctico para valorar el grado en que el estudiante ha adquirido las competencias establecidas.

Todo ello de acuerdo con la legislación vigente.

En la segunda parte (50%), la evaluación se realizará vía la elaboración de un proyecto empírico sobre modelos VAR. Máximo 5 hojas o 10 formato transparencia.