

DENOMINACIÓN ASIGNATURA: Técnicas Econométricas		
GRADO: Economía	CURSO: 3	CUATRIMESTRE: 1

**CRONOGRAMA DE LA ASIGNATURA**

Semana	Sesión	DESCRIPCIÓN DEL CONTENIDO DE LA SESIÓN	GRUPO (Marcar X)		Indicar espacio necesario distinto aula	TRABAJO DEL ALUMNO DURANTE LA SEMANA		
			Grande	Pequeño		DESCRIPCIÓN	Horas Presenciales	Horas Trabajo Semanal
1	1	<u>Características de los datos económicos de series temporales.</u> Procesos estocásticos y series temporales. Estacionariedad y ergodicidad. Función de autocorrelación simple (FAC) y parcial (PAC).  B&D capítulo I + Notas de clase	X			Elegir el proyecto empírico que se va a realizar durante el curso.  Resolución de ejercicios asignados.	1,5	5
1	2	Clase en aula informática:  Diferentes bases de datos económicos. Búsquedas de datos para el proyecto empírico. Problema 4 de la practica I		X		Búsqueda de datos para el proyecto. Resolución de ejercicios asignados.	1,5	
2	3	<u>Modelos univariantes estacionarios</u> Descomposición de Wold. Procesos ARMA. Modelos causales, modelos invertibles.  B&D capítulo II y III + Notas de clase	X			Lecturas y resolución de ejercicios asignados.	1,5	5
2	4	Clase en aula informática:  Introducción a Eviews: lectura de datos, gráficos, transformaciones, generación de datos, regresión.		X		Notificar al profesor del grupo reducido el proyecto que se va a realizar (país, variables, gráficos y artículo de apoyo) [Puede ser Evaluable]  Resolución y discusión de problemas y/o trabajos asignados.	1,5	
3	5	<u>Modelos univariantes estacionarios</u> Estimación e inferencia de la media y la FAC. Estimación e inferencia de los parámetros de los modelos ARMA.  B&D capítulo II y III + Notas de clase	X			Lecturas y resolución de ejercicios asignados.	1,5	5

DENOMINACIÓN ASIGNATURA: Técnicas Econométricas		
GRADO: Economía	CURSO: 3	CUATRIMESTRE: 1

### CRONOGRAMA DE LA ASIGNATURA

Semana	Sesión	DESCRIPCIÓN DEL CONTENIDO DE LA SESIÓN	GRUPO (Marcar X)		Indicar espacio necesario distinto aula	TRABAJO DEL ALUMNO DURANTE LA SEMANA		
			Grande	Pequeño		DESCRIPCIÓN	Horas Presenciales	Horas Trabajo Semanal
3	6	Clase en aula informática:  Simulación de modelos ARMA. Identificación de modelos ARMA y estimación. Problemas 5 y 6 de la practica I.		X		Resolución y discusión de problemas y/o trabajos asignados.	1,5	
4	7	<u>Modelos univariantes estacionarios</u> Contrastes de ruido blanco. Selección de modelos (criterios de información). Diferentes metodologías de construcción de modelos ARMA. Ejemplo con datos reales (tipos de interés, tasa de crecimiento del GDP, temperatura, etc)  B&D capítulo V + Notas de clase	X			Lecturas y resolución de ejercicios asignados.	1,5	5
4	8	Clase en aula informática:  Problemas 2, 3, 4, 5, y 6 de la práctica II.		X		Resolución y discusión de problemas y/o trabajos asignados.	1,5	
5	9	<u>Predicción</u> Elaboración de predicciones. Evaluación de predicciones. Combinación de predicciones.  B&D capítulo V + Notas de clase	X			Lecturas: Resolución de ejercicios asignados.	1,5	5

<b>DENOMINACIÓN ASIGNATURA: Técnicas Econométricas</b>		
<b>GRADO: Economía</b>	<b>CURSO: 3</b>	<b>CUATRIMESTRE: 1</b>

**CRONOGRAMA DE LA ASIGNATURA**

Semana	Sesión	DESCRIPCIÓN DEL CONTENIDO DE LA SESIÓN	GRUPO (Marcar X)		Indicar espacio necesario distinto aula	TRABAJO DEL ALUMNO DURANTE LA SEMANA		
			Grande	Pequeño		DESCRIPCIÓN	Horas Presenciales	Horas Trabajo Semanal
5	10	Clase en aula informática:  Selección de modelos. Predicción con Eviews. Predicción con datos reales.  Problemas practica III.		X		Notificar al profesor del grupo reducido el modelo univariante seleccionado para cada una de las variables del proyecto. [Puede ser Evaluable]  Resolución y discusión de problemas y/o trabajos asignados.	1,5	
6	11	<u>Regresión con autocorrelacion</u> Consecuencia de la existencia de errores autocorrelados. Inferencia robusta vía la estimación de errores standards HAC. Contrastes de autocorrelación. Problemas de endogeneidad (variable dependiente retardada), solución vía estimación por Variables Instrumentales (mínimos cuadrados bietápicos).  W capitulo 12.	X			Lecturas y resolución de ejercicios asignados.	1,5	5
6	12	Clase en aula informática:  Problemas practica III.		X		Resolución y discusión de problemas y/o trabajos asignados.	1,5	
7	13	<u>Regresion con autocorrelacion</u> Consecuencia de la existencia de errores autocorrelados. Inferencia robusta vía la estimación de errores standards HAC. Contrastes de autocorrelación. Problemas de endogeneidad (variable dependiente retardada), solución vía estimación por Variables Instrumentales (mínimos cuadrados bietápicos).  W capitulo 12 y 15.	X			Lecturas y resolución de ejercicios asignados.	1,5	5

DENOMINACIÓN ASIGNATURA: Técnicas Econométricas		
GRADO: Economía	CURSO: 3	CUATRIMESTRE: 1

**CRONOGRAMA DE LA ASIGNATURA**

Semana	Sesión	DESCRIPCIÓN DEL CONTENIDO DE LA SESIÓN	GRUPO (Marcar X)		Indicar espacio necesario distinto aula	TRABAJO DEL ALUMNO DURANTE LA SEMANA		
			Grande	Pequeño		DESCRIPCIÓN	Horas Presenciales	Horas Trabajo Semanal
7	14	Clase aula informática:  Puesta en práctica de todo el material cubierto hasta la fecha con vistas al proyecto empírico.		X		Resolución y discusión de problemas y/o trabajos asignados.	1,5	
8	15	<u>Modelos Econométricos dinámicos uni-ecuacionales</u> Modelos de retardos distribuidos (ADL). Multiplicadores de corto y largo plazo. Calculo de los retardos medio y mediano. Modelos de ajuste parcial. Estimación e inferencia sin y con autocorrelación en los errores.  S&W capitulo 13 + Notas de clase	X			Lecturas y resolución de ejercicios asignados.	1,5	5
8	16	Clase en aula informática:  Problemas de la practica IV.		X		Resolución y discusión de problemas y/o trabajos asignados. +  Notificar al profesor del grupo reducido el mejor modelo para cada variable analizada según las predicciones obtenidas. [Puede ser Evaluable]	1,5	
9	17	<u>Modelos dinámicos multi-ecuacionales.</u> Modelos VAR, forma estructural, forma reducida. Condiciones de identificabilidad. Análisis de causalidad en sentido de Granger. Estimación e inferencia. Función de respuesta a un impulso (IRF).  Notas de clase.	X			Lecturas y resolución de ejercicios asignados	1,5	5

DENOMINACIÓN ASIGNATURA: Técnicas Econométricas		
GRADO: Economía	CURSO: 3	CUATRIMESTRE: 1

**CRONOGRAMA DE LA ASIGNATURA**

Semana	Sesión	DESCRIPCIÓN DEL CONTENIDO DE LA SESIÓN	GRUPO (Marcar X)		Indicar espacio necesario distinto aula	TRABAJO DEL ALUMNO DURANTE LA SEMANA		
			Grande	Pequeño		DESCRIPCIÓN	Horas Presenciales	Horas Trabajo Semanal
9	18	Clase en aula informática:  Estimación e inferencia de modelos VAR con Eviews y datos reales. Análisis de causalidad. Interpretación de las IRF.				Notificar al profesor del grupo reducido el modelo dinámico uniecuacional seleccionado en el proyecto. [Puede ser Evaluable]  Resolución y discusión de problemas y/o trabajos asignados.	1,5	
10	19	Modelos dinámicos multi-ecuacionales. Modelos VAR, forma estructural, forma reducida. Condiciones de identificabilidad. Análisis de causalidad en sentido de Granger. Estimación e inferencia. Función de respuesta a un impulso (IRF).  Notas de clase.	X			Lecturas y resolución de ejercicios asignados.	1,5	5
10	20	Clase en aula informática:  Seguimiento del proyecto empírico: estimación e interpretación de modelos VAR		X		Resolución y discusión de problemas y/o trabajos asignados.	1,5	
11	21	Procesos no estacionarios Procesos estacionarios alrededor de una tendencia (TS) versus procesos integrados (DS). Contrastes de raíz unitaria Dickey-Fuller. Shocks permanentes y shocks transitorios. Predicción con modelos no estacionarios. Cambios estructurales.  S&W capítulo 14, W capítulo 18 + Notas de clase	X			Notificar al profesor del grupo reducido el modelo VAR seleccionado en el proyecto. [Evaluable]  Lecturas y resolución de ejercicios asignados.	1,5	5

DENOMINACIÓN ASIGNATURA: Técnicas Econométricas		
GRADO: Economía	CURSO: 3	CUATRIMESTRE: 1

**CRONOGRAMA DE LA ASIGNATURA**

Semana	Sesión	DESCRIPCIÓN DEL CONTENIDO DE LA SESIÓN	GRUPO (Marcar X)		Indicar espacio necesario distinto aula	TRABAJO DEL ALUMNO DURANTE LA SEMANA		
			Grande	Pequeño		DESCRIPCIÓN	Horas Presenciales	Horas Trabajo Semanal
11	22	Clase en aula informática:  Distribución del contraste de DF. El contraste aumentado de DF (ADF). Contraste de raíces unitarias en la práctica.		X		Resolución y discusión de problemas y/o trabajos asignados.	1,5	
12	23	<u>Procesos no estacionarios</u> Procesos estacionarios alrededor de una tendencia (TS) versus procesos integrados (DS). Contrastes de raíz unitaria Dickey-Fuller. Shocks permanentes y shocks transitorios. Predicción con modelos no estacionarios. Cambios estructurales.  S&W capítulo 14, W capítulo 18 + Notas de clase	X			Lecturas y resolución de ejercicios asignados.	1,5	5
12	24	Clase en aula informática:  Cambios estructurales versus raíces unitarias. Detección de cambios estructurales.		X		Notificar al profesor del grupo reducido los contrastes de raíz unitaria de las variables del proyecto. [Puede ser Evaluable] Resolución y discusión de problemas y/o trabajos asignados.	1,5	
13	25	<u>Regresión con variables no estacionarias</u> Regresión espuria. Cointegración. Modelos de corrección del error. Estimación e Inferencia en dos pasos.  S&W capítulo 14, W capítulo 18 + Notas de clase	X			Lecturas y resolución de ejercicios asignados.	1,5	5
13	26	Clase en aula informática:  Generación de regresiones espurias; generación de relaciones de cointegración. Aplicaciones con datos reales.		X		Resolución y discusión de problemas y/o trabajos asignados.	1,5	

DENOMINACIÓN ASIGNATURA: Técnicas Econométricas		
GRADO: Economía	CURSO: 3	CUATRIMESTRE: 1

**CRONOGRAMA DE LA ASIGNATURA**

Semana	Sesión	DESCRIPCIÓN DEL CONTENIDO DE LA SESIÓN	GRUPO (Marcar X)		Indicar espacio necesario distinto aula	TRABAJO DEL ALUMNO DURANTE LA SEMANA		
			Grande	Pequeño		DESCRIPCIÓN	Horas Presenciales	Horas Trabajo Semanal
14	27	Regresión con variables no estacionarias. Regresión espuria. Cointegración. Modelos de corrección del error. Estimación e Inferencia en dos pasos.  S&W capitulo 14, W capitulo 18 + Notas de clase	X			Lecturas y resolución de ejercicios asignados.	1,5	5
14	28	Clase en aula informática:  Detección de regresiones espurias, detección de cointegración. Estimación de modelos de corrección del error con datos reales.		X		Notificar al profesor del grupo reducido el análisis de cointegración de las variables del proyecto. [Puede ser Evaluable].  Resolución y discusión de problemas y/o trabajos asignados.	1,5	
<b>SUBTOTAL</b>							<b>120</b>	
15		Recuperaciones, tutorías, entrega del proyecto empírico, etc.					8	
16-18		Preparación de evaluación y evaluación.				Entrega del proyecto empírico final.	3	19
<b>TOTAL</b>							<b>150</b>	