



<b>DENOMINACIÓN ASIGNATURA: ECONOMETRIA II</b>		
<b>GRADO: GRADO EN FINANZAS Y CONTABILIDAD</b>	<b>CURSO: 3</b>	<b>CUATRIMESTRE: 1</b>

PLANIFICACIÓN SEMANAL DE LA ASIGNATURA								
SEMANA	SESIÓN	DESCRIPCIÓN DEL CONTENIDO DE LA SESIÓN	GRUPO (marcar X)		Indicar espacio distinto de aula (aula informática, audiovisual, etc.)	TRABAJO SEMANAL DEL ALUMNO		
			GRANDE	PEQUEÑO		DESCRIPCIÓN	HORAS PRESENCIALES	HORAS TRABAJO (Max. 7h semana)
1	1	Aplicaciones de la Econometría en el ámbito de la empresa. La Econometría de Series Temporales en la empresa. Muestras aleatorias. Datos de empresa en forma de series temporales: características de las mismas.	X			Estudio del tema de la sesión teórica.	1,5	
1	2	- Introducción a Eviews - Comparación entre muestras aleatorias y series temporales		X	INFORM	Estudio del tema de la sesión teórica.	1,5	
2	3	Estimación de estructuras determinísticas de tendencia y estacionalidad.	X		INFORM	Estudio del tema de la sesión 3. Obtención de series temporales del banco de datos. Cada alumno debe seleccionar tres series de diferente frecuencia temporal con las que trabajará en el resto del curso. Una de ellas	1,5	

						debe ser de frecuencia anual y otra de frecuencia mensual o trimestral.		
2	4	Evolutividad regular y estacional de la media en series temporales		X	INFORM		1,5	
3	5	Estructuras estocásticas de raíces unitarias para la tendencia y estacionalidad. Transformación de los datos originales para eliminar de los mismos la evolutividad tendencial y estacional, tanto de carácter determinista como estocástico. Niveles, tasas de crecimiento sobre el periodo inmediatamente anterior (CI) y tasas de crecimiento sobre el mismo período del año anterior (CA).	X			Estudio del tema de la sección 5. Seleccionar dos esquemas diferentes de tendencia y estacionalidad estocásticas y a partir de ellos obtener los esquemas correspondientes para las series de crecimiento CI y CA y discutir sus propiedades.	1,5	
3	6	Estimación de modelos deterministas		X	INFORM	Estudio de la sesión teórica y replicación de la sesión de ordenador.	1,5	
4	7	Variables aleatorias y procesos estocásticos. Procesos estocásticos estacionarios. El proceso ruido blanco. La dependencia temporal en procesos estocásticos estacionarios. La función de autocorrelación (FAC): estimación	X			Estudio del tema de la sesión 7.	1,5	
4	8	Modelización de cambios estructurales en el nivel y la tendencia		X	INFORM	Estudio de la sesión teórica y replicación de la sesión de ordenador.	1,5	
5	9	El modelo autorregresivo de primer orden AR(1). Los modelos ARI(1,1). Generalización a modelos AR(p) y ARI(1,p).	X			Estudio del tema de la sesión 9	1,5	
5	10	Análisis de correlogramas Eliminación de las raíces unitarias mediante la diferenciación.		X	INFORM	Estudio de la sesión teórica y replicación de la sesión de ordenador.	1,5	
6	11	Selección del orden autorregresivo. Retardos distribuidos largos con parquedad paramétrica	X			Estudio del tema de la sesión 11	1,5	
6	12	Análisis de correlogramas y modelización autoregresiva.		X	INFORM	Estudio del tema de la sesión 12	1,5	
7	13	Contrastes de raíces unitarias	X			Estudio del tema de la sesión 13	1,5	
7	14	Prueba de evaluación continua 1		X			1,5	
8	15	Modelos multivariantes estacionarios: VAR(p). La	X			Estudio del tema de la sesión 15	1,5	

		dependencia temporal. La causalidad en el sentido de Granger. La estimación de los modelos VAR.						
8	16	Contrastes de raíces unitarias (ADF y OCSB)		X	INFORM	Estudio de la sesión teórica y replicación de la sesión de ordenador.	1,5	
9	17	Modelo de regresión dinámica	X			Estudio del tema de la sesión 17	1,5	
9	18	Modelos econométricos uni-ecuacionales		X	INFORM	Estudio del tema de la sesión 18	1,5	
10	19	Cointegración	X			Estudio del tema de la sesión 19	1,5	
10	20	Contraste de causalidad de Granger y modelos VAR		X	INFORM	Estudio de la sesión teórica y replicación de la sesión de ordenador.	1,5	
11	21	Aplicación de contrastes de cointegración	X			Aplicación de contrastes de cointegración al Ejercicio multivariante de cada alumno.	1,5	
11	22	Cointegración. Contraste de Engle-Granger		X	INFORM		1,5	
12	23	Regresiones espurias	X			Estudio del tema de la sesión 23	1,5	
12	24	Cointegración. Test de Johansen		X	INFORM		1,5	
13	25	Análisis de multiplicadores	X			Estudio del tema de la sesión 25	1,5	
13	26	Resumen del curso		X	INFORM		1,5	
14	27	Resumen del curso	X				1,5	
14	28	Prueba de evaluación continua 2		X			1,5	
<b>Subtotal 1</b>							<b>42</b>	
<b>Total 1 (Horas presenciales y de trabajo del alumno entre las semanas 1-14)</b>								

15		Recuperaciones, tutorías, entrega de trabajos, etc						
16		Preparación de evaluación y evaluación					3	
17								
18								
<b>Subtotal 2</b>							<b>3</b>	
<b>Total 2 (Horas presenciales y de trabajo del alumno entre las semanas 15-18)</b>								

<b>TOTAL (Total 1 + Total 2)</b>							<b>150</b>	
----------------------------------	--	--	--	--	--	--	------------	--

