

27427 - Econometría II

Información del Plan Docente

Año académico: 2023/24

Asignatura: 27427 - Econometría II

Centro académico: 109 - Facultad de Economía y Empresa

Titulación: 417 - Graduado en Economía

Créditos: 6.0

Curso: 3

Periodo de impartición: Segundo semestre

Clase de asignatura: Obligatoria

Materia:

1. Información básica de la asignatura

Esta asignatura tiene como objetivo que el estudiante aprenda en primer lugar a contrastar las hipótesis básicas referentes a la parte aleatoria del modelo lineal general, como complemento de lo estudiado en la Econometría I. Y en una segunda parte, centrándonos en el análisis univariante de series temporales, el estudiante aprende la metodología Box-Jenkins, con objeto de obtener predicciones de dichas series.

Estos planteamientos y objetivos están alineados con los Objetivos de Desarrollo Sostenible (ODS) de la Agenda 2030 de Naciones Unidas (<https://www.un.org/sustainabledevelopment/es/>), en concreto, las actividades previstas en la asignatura contribuirán al logro de los objetivos Producción y consumo sostenibles (objetivo 12), educación (objetivo 4), igualdad de género (objetivo 5).

2. Resultados de aprendizaje

Al superar la asignatura el estudiante deberá dominar las técnicas que conforma las cuatro etapas esenciales del método econométrico: especificación, estimación, validación y la explotación del modelo, tanto en el caso de un modelo econométrico con varias variables explicativas como desde el punto de vista del análisis univariante de series temporales.

3. Programa de la asignatura

PARTE 1: AMPLIACIÓN DEL MODELO LINEAL GENERAL

Tema 1: Tema 1. Ampliaciones del modelo lineal general Tema 1. Análisis de esfericidad y uso de los modelos

PARTE II: ANÁLISIS DE SERIES TEMPORALES

Tema 2: Conceptos básicos: Modelos ARMA y ARIMA.

Tema 3: Metodología Box-Jenkins (I): Esquema general e identificación

Tema 4: Metodología Box-Jenkins (II): Estimación, chequeo y predicción

4. Actividades académicas

En las clases magistrales se impartirán los conceptos teóricos

Clases magistrales: 30 horas

Clases prácticas: 30 horas

Estudio Personal: 88 horas

Pruebas Evaluación: 4h (2h estarán fuera del horario de clase)

ECTS = 150 horas

En principio la metodología de impartición de la docencia y su evaluación está previsto que pivote alrededor de clases presenciales. No obstante, si las circunstancias lo requieren, podrán realizarse de forma online.

5. Sistema de evaluación

La asignatura se evaluará como evaluación continua en primera convocatoria y mediante evaluación global durante segunda convocatoria.

Evaluación continua

Se deberán realizar dos pruebas que constarán tanto de preguntas teóricas y prácticas como de ejercicios prácticos de ordenador a resolver con el programa Gretl. La primera prueba será sobre la primera parte del programa Ampliaciones del Modelo Lineal General. Esta prueba intermedia representará el 25% de la calificación final. La segunda prueba será sobre la parte segunda del programa Análisis de series temporales. Esta prueba representará el 75% de la calificación final. Para

superar la evaluación continua se tendrá que obtener un mínimo de 3.5 en cada prueba y la suma ponderada tendrá que ser mayor o igual que 5.

Evaluación global

Constará de cuestiones teóricas y prácticas de los contenidos del programa, algunas de estas cuestiones serán salidas del programa Gretl para interpretar o problemas para resolver utilizando dicho programa. El examen global tendrá también dos partes correspondientes a las dos partes del programa, respectivamente y la participación de cada una de ellas en la calificación final será como en la opción de la evaluación continua (25% la primera y 75% la segunda).

Criterios de Evaluación:

Los alumnos que no hayan superado la evaluación continua pero en alguna de las pruebas tengan una calificación igual o superior a 5 podrán optar a presentarse al examen final sólo a la parte no superada, con su porcentaje correspondiente, o a todo el examen, y su calificación final será el máximo entre la calificación del examen global o la media ponderada de la parte superada en la evaluación continua y la de la otra parte, en la prueba global.