

## 27427 - Econometría II

### Información del Plan Docente

**Año académico:** 2024/25

**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.

### 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.

## **6. Objetivos de Desarrollo Sostenible**

4 - Educación de Calidad

5 - Igualdad de Género