

GRADO EN TÉCNICAS CUANTITATIVAS PARA LA ECONOMÍA Y LA EMPRESA

ECONOMETRÍA			
Créditos ECTS:	18		
Carácter	Obligatoria		
Unidad temporal:	3 asignaturas <ul style="list-style-type: none"> • 1 asignatura en el cuarto cuatrimestre • 1 asignatura en el quinto cuatrimestre • 1 asignatura en el séptimo cuatrimestre 		
Requisitos Previos			
No se han establecido requisitos previos de acceso a esta materia			
SISTEMA DE EVALUACIÓN		PONDERACIÓN MIN	PONDERACIÓN MAX
Participación en foros y otros medios participativos		5%	15%
Realización de trabajos, proyectos y casos		15%	25%
Test de evaluación		10%	20%
Prueba de evaluación final presencial		60%	60%
COMPETENCIAS			
Generales	Específicas	Transversales	
CG1, CG2, CG3, CG4, CG5	CE2, CE6, CE10, CE12, CE13, CE15	CT1, CT2, CT3, CT4	
DESCRIPCIÓN DE LAS ASIGNATURAS			
Denominación de la asignatura	Cuatrimestre	Créditos ECTS	Carácter
Econometría I	4	6	Obligatoria
Econometría II	5	6	Obligatoria
Predicción económica	7	6	Obligatoria

ACTIVIDADES FORMATIVAS	HORAS	% PRESENCIAL
Sesiones Presenciales Virtuales	54	100%
Estudio Personal de material básico	340	0
Lectura de material complementario	41	0
Casos Prácticos	54	0
Evaluación	6	100%
Tutorías	15	50%
Foros y debates (trabajo colaborativo)	30	0
Total	540	
CONTENIDOS DE LAS ASIGNATURAS		
<p>Econometría I</p> <p>La naturaleza de la econometría y los datos económicos. El modelo lineal básico: regresión lineal múltiple, estimación mínimo cuadrática y máximo verosímil. Modelos con variables cualitativas: modelos logit y probit. Violación de supuestos (problemas de especificación y datos): test LR, mínimos cuadrados no lineales, test RESET de Ramsey y tamaño de muestra y multicolinealidad. Violación de supuestos (perturbaciones no esféricas): matriz de varianzas-covarianzas no escalar, heterocedasticidad, autocorrelación y contraste de Durbin-Watson.</p> <p>Econometría II</p> <p>Modelos de series temporales: análisis de estacionariedad de series, modelos de medias móviles (MA), autorregresivos (AR), ARMA y ARIMA. Metodología Box-Jenkins: identificación, estimación y chequeo de modelos ARIMA y elaboración y valoración de predicciones. VARMA y cointegración: regresión de series no estacionarias.</p> <p>Modelos econométricos dinámicos. Series temporales econométricas.</p> <p>Predicción económica</p> <p>Predicción a largo plazo: predicciones demográficas y curva logística, modelos econométricos y ecuaciones simultáneas y modelos sectoriales y regionales.</p> <p>Predicción a corto plazo: modelos temporales, uso de modelos ARIMA y VAR y análisis de coyuntura económica.</p> <p>Comparación y combinación de predicciones: sesgo, riesgo y la M-Competición.</p> <p>Transversal a todas las asignaturas</p> <p>Uso de software econométrico (GRET).</p>		