

Plan 445 Grado en Administración y Dirección de Empresas (Soria)

Asignatura 41982 ECONOMETRÍA II

Grupo 1

Presentación

Modelización con datos temporales: Modelos dinámicos, regresión con variables no estacionarias. Predicción con Series temporales: Modelos ARIMA.

Programa Básico

1.- Introducción al estudio de series temporales. Aplicación económica. Conceptos previos y aproximación estadística clásica.

2.- Procesos estocásticos. Características. Procesos estacionarios. Función de autocovarianzas. Función de autocorrelación. Momentos. Ruido blanco.

3.- Modelos lineales estacionarios. Modelo lineal general. Procesos AR. Procesos MA. Procesos ARMA.

4.- Procesos lineales no estacionarios. No estacionariedad en media. No estacionariedad en varianza. Modelos ARIMA. Paseo aleatorio.

5.- Modelización ARIMA. Estrategia. Identificación. Estimación. Validación del modelo.

6.- Predicción con modelos ARIMA. Modelos estacionarios. Modelos no estacionarios.

7.- Modelos ARIMA estacionales.

Objetivos

Aplicar la metodología econométrica al análisis de relaciones entre variables económicas, cuyo comportamiento está sometido a incertidumbre.

Tratar adecuadamente las peculiaridades de los modelos dinámicos, en los que el presente se explica a través de la evolución de la realidad económica.

Afrontar el análisis de relaciones entre variables económicas observadas a lo largo del tiempo, para las que no se cumplen los supuestos estadísticos generales, debido al comportamiento característico de gran parte de los procesos económicos temporales.

Predecir el comportamiento de las variables económicas utilizando técnicas de series temporales.

Armonizar el aprendizaje individual con el debate colectivo; trabajar en equipo; realizar aportaciones con espíritu crítico.

Mostrar destrezas en el manejo de software general para el análisis econométrico.

Poseer habilidades en la búsqueda de contenidos en el entorno bibliográfico, con la ayuda de las Tecnologías de la información y de la comunicación.

Programa de Teoría

Programa Práctico

Evaluación

Prueba presencial de valoración de los contenidos de la asignatura. Participación en las clases. Trabajo sobre los contenidos de la asignatura.

Bibliografía
