



Asignatura: **Econometría II**
Código: 18272
Centro: **Ciencias Económicas**
Titulación: Economía y Finanzas
Nivel: **Grado**
Tipo: Obligatoria
Nº. de Créditos: 6

ASIGNATURA / COURSE TITLE

Econometría II / Econometrics II

1.1. Código / Course number

18272

1.2. Materia/ Content area

Econometría / Econometrics

1.3. Tipo / Course type

Obligatoria / Mandatory

1.4. Nivel / Course level

Grado / Bachelor's Degree

1.5. Curso / Year

Tercero / Third

1.6. Semestre / Semester

Segundo / Second

1.7. Número de créditos / Credit allotment

6 ECTS / 6 credits

1.8. Requisitos previos / Prerequisites

Econometría I, así como conocimiento básico de Álgebra Matricial, Cálculo y Estadística/*Econometrics I, and basic knowledge of Matrix Algebra, Calculus and Statistics.*



Asignatura: **Econometría II**
Código: 18272
Centro: **Ciencias Económicas**
Titulación: Economía y Finanzas
Nivel: **Grado**
Tipo: Obligatoria
Nº. de Créditos: 6

1.9. Requisitos mínimos de asistencia a las sesiones presenciales/ **Minimum attendance requirement**

No hay requisitos mínimos de asistencia, si bien la participación activa en las clases, así como la entrega de los ejercicios y trabajos propuestos, tendrán influencia en la nota final como parte de la evaluación continua. / **There are no minimum requirements for attendance, although the active class participation as well as homeworks will have an impact in the final grade.**

1.10. Datos del equipo docente / **Faculty data**

El equipo docente está integrado por profesores del siguiente departamento:
/ **The faculty is composed of professors from the following department:**

Departamento de Análisis Económico: Economía Cuantitativa. UDI de Econometría

Módulo E-3

Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales

C/ Francisco Tomás y Valiente, 5

Universidad Autónoma de Madrid

28049 Madrid

Secretaría: Despacho E-3-304

Tel.: (+34) 91 497 4813

Fax: (+34) 91 497 2991

Los profesores concretos encargados de la docencia de cada asignatura aparecen en los horarios de cada curso académico, disponibles en la página web del Grado: / **The professors in charge of teaching each subject can be seen in each academic course schedule, which is available at the web page:**

http://www.uam.es/ss/Satellite/Economicas/es/1242654732921/contenidoFinal/Grado_en_Economia_y_Finanzas_%28bilingue%29.htm

1.11. Objetivos del curso / **Course objectives**

Familiarizar al estudiante con los métodos econométricos propios del análisis de series temporales económicas y financieras. Introducir las técnicas de simulación. / **To introduce econometric methods for the analysis of economic and financial time series. To introduce simulation methods.**



Asignatura: **Econometría II**
Código: 18272
Centro: **Ciencias Económicas**
Titulación: Economía y Finanzas
Nivel: **Grado**
Tipo: Obligatoria
Nº. de Créditos: 6

Competencias genéricas

Instrumentales

01. Capacidad de análisis y síntesis.
02. Comunicación oral y escrita en lengua nativa.
03. Conocimientos de informática relativos al ámbito de estudio.
04. Capacidad de tomar decisiones.

Interpersonales

05. Capacidad para trabajar en equipo.
06. Capacidad crítica y autocrítica.

Sistémicas

07. Capacidad para aplicar los conocimientos en la práctica.
08. Habilidades de investigación.
09. Capacidad de aprendizaje autónomo.

Competencias específicas

10. Aportar racionalidad al análisis y a la descripción de cualquier aspecto de la realidad económica.
11. Redactar proyectos de gestión económica a nivel internacional, nacional o regional.
12. Identificar las fuentes de información económica relevante y su contenido.
13. Derivar de los datos información relevante imposible de reconocer por no profesionales.

1.12. Contenidos del programa / **Course contents**

- Tema 1: Introducción a las series temporales
Tema 2: Modelos AR, MA y ARMA
Tema 3: Predicción con modelos AR, MA y ARMA.
Tema 4: No estacionariedad
Tema 5: Volatilidad

- [Topic 1: Introduction to time series analysis](#)
[Topic 2: AR, MA and ARMA models](#)
[Topic 3: Forecasting with AR, MA and ARMA models.](#)
[Topic 4: Non-stationarity](#)
[Topic 5: Volatility](#)



Asignatura: **Econometría II**
Código: 18272
Centro: **Ciencias Económicas**
Titulación: Economía y Finanzas
Nivel: **Grado**
Tipo: Obligatoria
Nº. de Créditos: 6

1.13. Referencias de consulta / **Course bibliography**

González-Rivera, G. (2013): *Forecasting for Economics and Business*, Pearson Education.

Peña, D. (2010): *Análisis de series temporales*, Alianza Editorial.

2. **Métodos Docentes / Teaching methodology**

La metodología docente consistirá en clases teóricas regulares y clases prácticas en las que se manejarán distintas aplicaciones informáticas. Además, los alumnos deberán realizar ejercicios empíricos en los que aplicarán a problemas con datos reales los conocimientos adquiridos en el curso.

Teaching methodology consists on lectures as well as practical examples, both in the classroom and lab. Students must also work on empirical exercises with real data.

3. **Tiempo de trabajo del estudiante / Student workload**

Esta asignatura tiene asignados 6 créditos ECTS que equivalen a 150 horas de trabajo para el estudiante.

This course gives the student 6 credits, which means 150 working hours.

4. **Métodos de evaluación y porcentaje en la calificación final / Evaluation procedures and weight of components in the final grade**

La evaluación de la asignatura se realiza teniendo en cuenta los siguientes aspectos:

- Examen final en la fecha que determine la Junta de Facultad. La calificación en el examen final deberá ser superior o igual a 4 (sobre 10) para tener en consideración lo obtenido mediante la evaluación continua.



Asignatura: **Econometría II**
Código: 18272
Centro: **Ciencias Económicas**
Titulación: Economía y Finanzas
Nivel: **Grado**
Tipo: Obligatoria
Nº. de Créditos: 6

- Evaluación continua durante el curso que supondrá hasta el 30% de la nota final. El profesor concretará al comienzo del curso las actividades a realizar y la valoración de cada una de ellas.

La calificación final en ambas convocatorias será la máxima entre las siguientes dos opciones:

- La nota del examen final.
- La nota ponderada resultado de la evaluación continua (30%) y del examen final (70%).

Si no se participa en el examen final, la calificación final será No evaluado. Los criterios anteriores son también aplicables a los alumnos de segunda matrícula.

The grade is based on the following criteria:

- Final exam. The grade in the final examen must be greater or equal than 4 points (out of 10) to take into account the marks obtained from the continuous assessment.
- Continuous assessment. It accounts for up to 30% of the final grade. The teacher will inform about the activities to be done along the course, as well as their evaluation.

The final grade in both the ordinary and extraordinary evaluations will be the maximum between the following two options:

- The grade in the final exam.
- The result of weighting the grade in the continuous assessment (30%) and the grade in the final exam (70%).

If the student does not take the final exam, the final grade will be No evaluated. These criteria are also applicable to students who are taking the course for the second time.



Asignatura: **Econometría II**
Código: 18272
Centro: **Ciencias Económicas**
Titulación: Economía y Finanzas
Nivel: **Grado**
Tipo: Obligatoria
Nº. de Créditos: 6

5. Cronograma* / **Course calendar**

Semana	Contenido
1-3	Tema 1
4-6	Tema 2
7-9	Tema 3
10-12	Tema 4
13-15	Tema 5

*Este cronograma tiene carácter orientativo

Week	Contents
1-3	Topic 1
4-6	Topic 2
7-9	Topic 3
10-12	Topic 4
13-15	Topic 5

*This schedule is orientative