

# Econometría de series temporales

**MÁSTER UNIVERSITARIO EN ECONOMÍA Y FINANZAS**

***UNIVERSIDAD INTERNACIONAL MENÉNDEZ PELAYO***

Este documento puede utilizarse como documentación de referencia de esta asignatura para la solicitud de reconocimiento de créditos en otros estudios. Para su plena validez debe estar sellado por la Secretaría de Estudiantes UIMP.



## DATOS GENERALES

### Breve descripción

Esta asignatura forma parte del Módulo II, que contiene asignaturas que proporcionan conocimientos avanzados en una gran variedad de áreas de la economía, que los alumnos eligen libremente. Algunos campos se cubren en una sola asignatura, mientras que otros se estructuran a través de varias asignaturas, en los trimestres tercero al quinto. Los alumnos pueden elegir entre todas las asignaturas optativas ofrecidas, con la única restricción de cursar al menos tres por cada trimestre.

### Título asignatura

Econometría de series temporales

### Código asignatura

101119

### Curso académico

2022-23

### Planes donde se imparte

[MÁSTER UNIVERSITARIO EN ECONOMÍA Y FINANZAS](#)

### Créditos ECTS

6

### Carácter de la asignatura

OPTATIVA

### Duración

Cuatrimestral

### Idioma

Inglés

# CONTENIDOS

## Contenidos

- Series temporales univariantes y multivariantes.
- Raíces unitarias y cointegración.
- Modelos no lineales.
- Propiedades de los estimadores máximo-verosímiles.
- Contrastes de hipótesis clásicos y de especificación.
- Modelos de regresión dinámicos.

# COMPETENCIAS

## Generales

G1 - Demostrar unos sólidos conocimientos de teoría económica y de las técnicas económicas, econométricas y computacionales relevantes.

G2 - Aplicar los conocimientos adquiridos y ser capaz de resolver problemas en entornos nuevos o poco conocidos dentro de contextos más amplios o multidisciplinares relacionados con el estudio de la economía y las finanzas.

G3 - Integrar sus conocimientos y estar capacitado para formular juicios a partir de una información incompleta o limitada, que incluya reflexiones sobre las responsabilidades sociales y éticas vinculadas a la aplicación de sus conocimientos y juicios económicos.

G4 - Analizar de forma crítica, evaluar y sintetizar ideas nuevas y complejas en relación con teorías y metodologías empíricas en el ámbito de la economía.

G5 - Diseñar y llevar a cabo un proyecto de investigación con un alto nivel académico, formulando hipótesis razonables, en el área de la economía.

G6 - Presentar oralmente trabajos científicos y técnicos en economía, a públicos especializados y no especializados, de un modo claro y sin ambigüedades.

G7 - Elaborar adecuadamente composiciones escritas y redactar proyectos de trabajo o artículos científicos.

G8 - Organizar y planificar su propio trabajo, fomentando la iniciativa y el espíritu emprendedor.

G9 - Integrarse en grupos de trabajo dedicados a proyectos de investigación económica.

G10 - Demostrar capacidad de estudio, síntesis y autonomía suficientes para, una vez finalizado el Máster, llevar a cabo una tesis doctoral en el área de la economía.

## Específicas

EO12 - Conocer los modelos econométricos apropiados para describir y predecir diversas series temporales económicas, así como para analizar las relaciones entre ellas sugeridas por la teoría económica.

# **PLAN DE APRENDIZAJE**

## **Actividades formativas**

AF1.- Clases teóricas

AF2.- Clases prácticas

AF5.- Estudio del contenido teórico del curso

AF6.- Resolución de ejercicios prácticos

AF7.- Preparación de presentaciones en clase

## **Metodologías docentes**

- Clases teóricas en las que se desarrollan los temas del programa de la asignatura.
- Clases prácticas en las que los alumnos resuelven ejercicios previamente distribuidos por el profesor.

## **Resultados de aprendizaje**

- Conocer los modelos econométricos apropiados para describir y predecir diversas series temporales económicas, así como para analizar las relaciones entre ellas sugeridas por la teoría económica.

# **SISTEMA DE EVALUACIÓN**

## **Descripción del sistema de evaluación**

SE1.- Ejercicios

SE2.- Presentaciones

SE4.- Exámenes

## **PROFESORADO**

### **Profesor responsable**

**Sentana Iváñez, Enrique**

*Doctor en Economía, London School of Economics*

*Profesor de Economía*

*Centro de Estudios Monetarios y Financieros (CEMFI)*

### **Profesorado**

Profesor Responsable de la asignatura

# HORARIO

## Horario

Esta asignatura de carácter optativo se imparte en el tercer trimestre, dentro del Módulo II (este módulo se imparte en los trimestres tercero, cuatro y quinto).

En el tercer trimestre el estudiante puede elegir 3 de las siguientes asignaturas, con una carga lectiva de 6 ECTS cada una de ellas:

- Cód. 101116 - Economía industrial
- Cód. 101117 - Economía pública
- Cód. 101118 - Macroeconomía II
- Cód. 101119 - Econometría de series temporales
- Cód. 101120 - Valoración de activos I
- Cód. 101121 - Finanzas empresariales