

GUIA DOCENTE DE LA ASIGNATURA

ECONOMETRÍA III

Aprobada en Consejo de Departamento el día 01/07/2013

MÓDULO	MATERIA	CURSO	SEMESTRE	CRÉDITOS	TIPO
Métodos cuantitativos	Econometría	4º	7º	6	Obligatoria
PROFESOR(ES)			DIRECCIÓN COMPLETA DE CONTACTO PARA TUTORÍAS (Dirección postal, teléfono, correo electrónico, etc.)		
Grupo A: Carlos Sánchez González Grupo B: Teresa García Muñoz (Coordinadora)			Carlos Sánchez González Despacho C-225 csanchez@ugr.es Tfno: 958249909 Teresa García Muñoz Despacho C-208 tgarciam@ugr.es Tfno: 958249914		
			HORARIO DE TUTORÍAS		
			Carlos Sánchez González L: 11,30-13,30; M: 8,30-10,30; X: 10,30-12,30 Teresa García Muñoz M: 9,30-11,30; X:15,30-17,30; J: 15,30-17,30		
GRADO EN EL QUE SE IMPARTE			OTROS GRADOS A LOS QUE SE PODRÍA OFERTAR		
Grado en Economía					
PRERREQUISITOS Y/O RECOMENDACIONES (si procede)					
Los señalados para las asignaturas de Econometría 1 y Econometría 2 y los conocimientos adquiridos en estas dos últimas					
BREVE DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS (SEGÚN MEMORIA DE VERIFICACIÓN DEL GRADO)					
1- Modelos unidimensionales de series temporales 2- Modelos de volatilidad estocástica, ARCH y GARCH					



ugr | Universidad
de Granada

INFORMACIÓN SOBRE TITULACIONES DE LA UGR
<http://grados.ugr.es>

Firmado por: ROSA MARÍA GARCÍA FERNANDEZ Secretario/a de Departamento

Sello de tiempo: 12/03/2019 12:38:53 Página: 1 / 5



FPB2SMjxi5TgMTGPDEX0h35CKCJ3NmbA

La integridad de este documento se puede verificar en la dirección <https://sede.ugr.es/verifirma/pfinicio.jsp> introduciendo el código de verificación que aparece debajo del código de barras.

- 3- Modelos Dinámicos.
 4- Modelos VAR
 5- Modelos de corrección de errores
 6- Modelos de Filtrado. Filtrado de Kalman. Filtrado de Nahi. Aplicaciones Económicas

COMPETENCIAS GENERALES Y ESPECÍFICAS

Especificar, estimar y verificar modelos econométricos válidos para situaciones en las que se dispone de datos de alta frecuencia donde los procedimientos tipo Box Jenkins resultan adecuados

OBJETIVOS (EXPRESADOS COMO RESULTADOS ESPERABLES DE LA ENSEÑANZA)

- Modelizar series temporales univariantes
- Especificar, estimar y contrastar modelos vectoriales de series temporales

TEMARIO DETALLADO DE LA ASIGNATURA

- 1 Modelos unidimensionales de series temporales.
 Proceso estocástico, ruido blanco, paseo aleatorio, estacionariedad
 Estimación de funciones de autocorrelación simple y parcial
 Modelos autorregresivos
 Modelos de medias móviles
 Modelos ARMA
 Estacionariedad e invertibilidad
 Predicciones con modelos ARIMA
 Estimación de modelos ARIMA
 Diagnóstico de modelos
2. Modelos de Volatilidad Estocástica, ARCH y GARCH
 El modelo ARCH (1)
 El modelo ARCH(q). ARCH en media y ARCH generalizado
 Estimación MV del modelo GARCH
3. Modelos dinámicos
 Modelos de función de transferencia
 Identificación, Estimación y Verificación de modelos de función de transferencia
 Regresión entre procesos no estacionarios
 Contrastes de Raíz Unitaria
 Integración y estacionariedad
 Estacionariedad y Cointegración
4. Modelos VAR
 Estimación de modelos VAR



ugr | Universidad
de Granada

INFORMACIÓN SOBRE TITULACIONES DE LA UGR
<http://grados.ugr.es>

Firmado por: ROSA MARÍA GARCÍA FERNANDEZ Secretario/a de Departamento

Sello de tiempo: 12/03/2019 12:38:53 Página: 2 / 5



FPB2SMjxi5TgMTGPDEX0h35CKCJ3NmbA

La integridad de este documento se puede verificar en la dirección <https://sede.ugr.es/verifirma/pfinicio.jsp> introduciendo el código de verificación que aparece debajo del código de barras.

Test de Causalidad de Granger
 Estimación de máxima verosimilitud
 La función de respuesta al impulso
 Descomposición de la varianza
 Errores estandard para la función de respuesta al impulso

5. Modelos de corrección de errores
 Estimación de los modelos de corrección de errores
 Restricciones en los parámetros
 Predicciones
 Análisis de la función de respuesta a impulsos

6. Modelos de Filtrado, El filtro de Kalman, El filtro de Nahi. Aplicaciones Económicas
 Representación en el espacio de los Estados de un modelo dinámico
 Obtención del Filtro de Kalman
 Predicciones basadas en la representación en el espacio de los estados
 Suavizado
 El filtro de Nahi
 Aplicaciones Económicas

BIBLIOGRAFÍA

BIBLIOGRAFÍA

BIBLIOGRAFÍA FUNDAMENTAL

Gujarati, D. (1992). Econometría. Ed. McGraw Hill.
 Johnston, J. (1987). Métodos de Econometría. Ed. Vicens-Vives.
 Herrerías, R. y Sánchez, C (1995): Ejercicios de Econometría. Ed. Proyecto Sur.
 Sánchez, C. (1999) Métodos Econométricos. Ariel Economía. Barcelona.
 Salvatore, D. (1983): Econometría. Ed. McGraw Hill, Serie Schaum.
 Uriel, y otros (1990): Econometría. El Modelo Lineal. Ed. A. C.

BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA

Kmenta, J. (1987): Elementos de Econometría- Ed- Vicens Vives.
 Novales, A. (1988). Econometría. Ed. McGraw Hill
 Pulido, A. (1989). Modelos Econométricos. Ed. Pirámide.
 Martín, G. Labeaga, JM. y Mochón, F. (1997). Introducción a la Econometría. Ed. Prentice Hall.
 Guisán, MC (1997). Econometría. Ed McGraw Hill
 Intriligator y otros (1996): Econometric Models, Techniques and Applications. Prentice Hall.
 Greene (1999): Análisis Econométrico. Ed. Prentice Hall.

ENLACES RECOMENDADOS

METODOLOGÍA DOCENTE

La metodología de la asignatura está basada en clases presenciales en las que se explican todos los contenidos teóricos, realizando numerosos ejercicios prácticos relacionados con los conceptos presentados en las clases teóricas. Además se incluirán aplicaciones informáticas de uso generalizado tales como los programas Gretl y E-Views.



ugr | Universidad
de Granada

INFORMACIÓN SOBRE TITULACIONES DE LA UGR
<http://grados.ugr.es>

Firmado por: ROSA MARÍA GARCÍA FERNANDEZ Secretario/a de Departamento

Sello de tiempo: 12/03/2019 12:38:53 Página: 3 / 5



FPB2SMjxi5TgMTGPDEX0h35CKCJ3NmbA

La integridad de este documento se puede verificar en la dirección <https://sede.ugr.es/verifirma/pfinicio.jsp> introduciendo el código de verificación que aparece debajo del código de barras.

PROGRAMA DE ACTIVIDADES											
Primer cuatrimestre	Temas del temario	Actividades presenciales (NOTA: Modificar según la metodología docente propuesta para la asignatura)						Actividades no presenciales (NOTA: Modificar según la metodología docente propuesta para la asignatura)			
		Sesiones teóricas (horas)	Sesiones prácticas (horas)	Exposiciones y seminarios (horas)	Tutorías colectivas (horas)	Exámenes (horas)	Etc.	Tutorías individuales (horas)	Estudio y trabajo individual del alumno (horas)	Trabajo en grupo (horas)	Etc.
Semana 1	1	3	1								
Semana 2	1	3	1								
Semana 3	1	3	1								
Semana 4	2	3	1								
Semana 5	2	3	1								
Semana 6	2	3	1								
Semana 7	3	3	1								
Semana 8	3	3	1								
Semana 9	3	3	1								
Semana 10	4	3	1								
Semana 11	4	3	1								
Semana 12	5	3	1								
Semana 13	5	3	1								
Semana 14	6	3	1								
Semana 15	6	3	1								



ugr | Universidad
de Granada

INFORMACIÓN SOBRE TITULACIONES DE LA UGR
<http://grados.ugr.es>

Firmado por: ROSA MARÍA GARCÍA FERNANDEZ Secretario/a de Departamento

Sello de tiempo: 12/03/2019 12:38:53 Página: 4 / 5



FPB2SMjxi5TgMTGPDEX0h35CKCJ3NmbA

La integridad de este documento se puede verificar en la dirección <https://sede.ugr.es/verifirma/pfinicio.jsp> introduciendo el código de verificación que aparece debajo del código de barras.

Total horas		45	15							
EVALUACIÓN (INSTRUMENTOS DE EVALUACIÓN, CRITERIOS DE EVALUACIÓN Y PORCENTAJE SOBRE LA CALIFICACIÓN FINAL, ETC.)										
<p>Con objeto de evaluar la adquisición de los contenidos y competencias a desarrollar en la materia, se utilizará un sistema de evaluación diversificado, seleccionando las técnicas de evaluación más adecuadas para la asignatura en cada momento, que permita poner de manifiesto los diferentes conocimientos y capacidades adquiridos por el alumnado al cursar la asignatura. De entre las siguientes técnicas evaluativas se utilizarán alguna o algunas de ellas: Prueba escrita: exámenes de ensayo, pruebas objetivas, resolución de problemas, casos o supuestos, pruebas de respuesta breve, informes y diarios de clase. Prueba oral: exposiciones de trabajos orales en clase, individuales o en grupo, sobre contenidos de la asignatura (seminario) y sobre ejecución de tareas prácticas correspondientes a competencias concretas. Observación: escalas de observación, en donde se registran conductas que realiza el alumno en la ejecución de tareas o actividades que se correspondan con las competencias. Técnicas basadas en la asistencia y participación activa del alumno en clase, seminarios y tutorías: trabajos en grupos reducidos sobre supuestos prácticos propuestos. El sistema de calificaciones se expresará mediante calificación numérica de acuerdo con lo establecido en el art. 5 del R. D 1125/2003, de 5 de septiembre, por el que se establece el sistema europeo de créditos y el sistema de calificaciones en las titulaciones universitarias de carácter oficial y validez en el territorio nacional. La calificación global corresponderá a la puntuación ponderada de los diferentes aspectos y actividades que integran el sistema de evaluación.</p> <p>En concreto, el procedimiento de evaluación será el siguiente: Aquellos alumnos que lo soliciten al Director del Departamento, en los plazos que recoge la normativa aplicable, podrán acogerse a la evaluación final única, a calificar sobre 10 puntos, 5 de teoría y 5 de práctica. La calificación final será la media aritmética simple de las dos partes. Para poder realizar la media se requiere un mínimo de 3,5 puntos en teoría y 3,5 puntos en práctica.</p> <p>Los alumnos que opten por el sistema de evaluación continua (el resto), realizarán dos pruebas parciales, igualmente con parte teórica y parte práctica. Estas pruebas parciales se evalúan de 0 a 10 puntos, 5 de teoría y 5 de práctica. La calificación final será la media aritmética simple de las dos partes. Para poder realizar la media se requiere un mínimo de 3,5 puntos en teoría y 3,5 puntos en práctica. En cada prueba parcial habrá que obtener un mínimo de 5 puntos. La calificación final será la media aritmética simple de ambos parciales.</p> <p>Caso de obtener menos de 5 puntos en alguno de los dos parciales, el alumno deberá presentarse obligatoriamente al examen final. En este caso la puntuación obtenida en el mismo se ponderará por 0,7 y la media de los dos parciales efectuados por 0,3, obteniéndose así la calificación final como la media ponderada de ambas calificaciones.</p> <p>En las convocatorias extraordinarias, se efectuará un examen único a calificar sobre 10 puntos, 5 de teoría y 5 de práctica. La calificación final será la media aritmética simple de las dos partes. Para poder realizar la media se requiere un mínimo de 3,5 puntos en teoría y 3,5 puntos en práctica.</p>										
INFORMACIÓN ADICIONAL										



ugr | Universidad
de Granada

INFORMACIÓN SOBRE TITULACIONES DE LA UGR
<http://grados.ugr.es>

Firmado por: ROSA MARÍA GARCÍA FERNANDEZ Secretario/a de Departamento

Sello de tiempo: 12/03/2019 12:38:53 Página: 5 / 5



FPB2SMjxi5TgMTGPDEX0h35CKCJ3NmbA

La integridad de este documento se puede verificar en la dirección <https://sede.ugr.es/verifirma/pfinicio.jsp> introduciendo el código de verificación que aparece debajo del código de barras.