



Máster Universitario en Economía

Universidad Complutense de Madrid

Curso 2014-2015

Asignatura: Métodos cuantitativos II: Previsión empresarial y modelos para finanzas (605160)

Información de la asignatura

Módulo 1. Fundamentos de Economía. Materia 1.2. Economía Cuantitativa

Carácter: Obligatoria

Créditos ECTS: 4

Presenciales: 2

No presenciales: 2

Trimestre: Segundo

Horas semanales presenciales: 3 horas de clase + 1 hora de seminario (clase práctica)

Profesores

Miguel Jerez Méndez

Departamento Fundamentos del Análisis Económico II

Facultad CC. Económicas y Empresariales

E-mail: mjerez@ccee.ucm.es

Marcos Bujosa Brun

Departamento Fundamentos del Análisis Económico II

Facultad CC. Económicas y Empresariales

E-mail: mbujosa@ccee.ucm.es

Breve Sinopsis de la Asignatura

Visión panorámica de las principales técnicas de previsión basadas en la econometría de series temporales.

Requisitos

No se exige ningún requisito adicional a los del Master

Objetivos Formativos

Proporcionar al alumno competencias teórico-prácticas en el diseño, mantenimiento y explotación de sistemas de previsión económica y empresarial..

Competencias

- Generales:*
- CG1: Dominio de los fundamentos de la economía y de al menos alguna de las áreas de la economía aplicada, así como de la metodología académica/profesional de dichas áreas.
 - CG2: Capacidad de identificar las fuentes relevantes de información económica (bases de datos, libros, artículos, etc.), de manejar adecuadamente esa información y de comprender y analizar críticamente dichas fuentes.
 - CG3: Capacidad de realizar un análisis crítico, evaluación y síntesis de ideas nuevas y complejas en economía a nivel avanzado.
 - CG4: Capacidad de resolver de forma autónoma tareas de investigación en economía.
 - CG5: Capacidad de redacción de informes profesionales y trabajos académicos en el ámbito de la economía.
 - CG6: Capacidad de desempeñar de forma competente puestos académicos y/o profesionales relacionados con la ciencia económica.
 - CG7: Capacidad de fomentar, en contextos académicos y profesionales, el progreso económico y social dentro de una sociedad basada en el conocimiento.
 - CG8: Capacidad de recibir y transmitir información en otros idiomas, principalmente inglés.
 - CG9: Capacidad de manejar adecuadamente las tecnologías de la información y las aplicaciones informáticas necesarias para el análisis económico.
- Específicas:*
- CE1: Aprender a formular problemas económicos relativos a decisiones de los agentes en lenguaje matemático y asimilar la estructura típica de los problemas de optimización condicionada.
 - CE3: Conocer en profundidad los modelos macroeconómicos básicos y ser capaces de analizar el comportamiento de las variables macroeconómicas básicas y aprender las conexiones entre ellas.
 - CE4: Entender el funcionamiento básico de una economía moderna, centrándose en el análisis micro y macroeconómico y en el uso de las herramientas estadísticas y econométricas de uso habitual en la investigación aplicada.
 - CE5: Dominar la búsqueda y manejo de fuentes cuantitativas y cualitativas, primarias y secundarias, relevantes para el estudio de la economía. Identificar la información relevante y saber criticar, evaluar y tratar el contenido de las fuentes.

Contenidos temáticos, planificación docente y bibliografía por temas

TEMA 1: Regresión con variable dependiente continua

Duración del Tema en clases: 6

Actividades dentro del Aula: Clases teóricas magistrales, Prácticas informáticas, Resolución de ejercicios, Discusión de casos o artículos

Actividades fuera del Aula: Preparación de materiales previamente a las clases, Resolución de ejercicios, Resolución de prácticas (informáticas o de ejercicios de cierta dificultad), Redacción de casos o trabajos, Búsqueda de información, Estudio de los conceptos básicos

Tiempo fuera del aula: 6 horas

Bibliografía del Tema:
Wooldridge, J. (2008), Introductory Econometrics: A Modern Approach, 4th Edition. South Western Educational Publishing, Cincinnati.

TEMA 2: Tópicos sobre regresión con datos de sección cruzada

Duración del Tema en clases: 4

Actividades dentro del Aula: Clases teóricas magistrales, Prácticas informáticas, Resolución de ejercicios, Discusión de casos o artículos

Actividades fuera del Aula: Preparación de materiales previamente a las clases, Resolución de ejercicios, Resolución de prácticas (informáticas o de ejercicios de cierta dificultad), Redacción de casos o trabajos, Búsqueda de información, Estudio de los conceptos básicos

Tiempo fuera del aula: 8 horas

Bibliografía del Tema:
Wooldridge, J. (2008), Introductory Econometrics: A Modern Approach, 4th Edition. South Western Educational Publishing, Cincinnati.

TEMA 3: Fundamentos de análisis de series temporales

Duración del Tema en clases: 6

Actividades dentro del Aula: Clases teóricas magistrales, Prácticas informáticas, Resolución de ejercicios, Discusión de casos o artículos

Actividades fuera del Aula: Preparación de materiales previamente a las clases, Resolución de ejercicios, Resolución de prácticas (informáticas o de ejercicios de cierta dificultad), Redacción de casos o trabajos, Búsqueda de información, Estudio de los

Tiempo fuera del aula: conceptos básicos
8 horas

Bibliografía del Tema:

Diebold, F.X. (2007), Elements of Forecasting, 4th Edition. South-Western College Publishing, Cincinnati. B

Box, G.E.P.; Jenkins, G.M. y Reinsel, G.C. (2008), Time Series Analysis: Forecasting and Control, 4th Edition. Wiley, New York.

TEMA 4: Tópicos sobre análisis de series temporales

Duración del Tema en clases: 4

Actividades dentro del Aula: Clases teóricas magistrales, Prácticas informáticas, Resolución de ejercicios, Discusión de casos o artículos

Actividades fuera del Aula: Preparación de materiales previamente a las clases, Resolución de ejercicios, Resolución de prácticas (informáticas o de ejercicios de cierta dificultad), Redacción de casos o trabajos, Búsqueda de información, Estudio de los conceptos básicos

Tiempo fuera del aula: 8 horas

Bibliografía del Tema:

Diebold, F.X. (2007), Elements of Forecasting, 4th Edition. South-Western College Publishing, Cincinnati. B

Box, G.E.P.; Jenkins, G.M. y Reinsel, G.C. (2008), Time Series Analysis: Forecasting and Control, 4th Edition. Wiley, New York.

Evaluación

- 20% Evaluación continua del trabajo personal del alumno
- 40% Realización y presentación de informes y trabajos
- 40% Prueba final escrita

Herramientas que se utilizan en esta asignatura

Campus Virtual