

Año académico	2015-16
Asignatura	21205 - Econometría
Grupo	Grupo 68, 1S, Menorca, GADE
Guía docente	L
Idioma	Castellano

Identificación de la asignatura

Asignatura	21205 - Econometría
Créditos	2,4 presenciales (60 horas) 3,6 no presenciales (90 horas) 6 totales (150 horas).
Grupo	Grupo 68, 1S, Menorca, GADE (Campus Extens Illes)
Período de impartición	Primer semestre
Idioma de impartición	Catalán

Profesores

Profesor/a	Horario de atención a los alumnos					
	Hora de inicio	Hora de fin	Día	Fecha inicial	Fecha final	Despacho
Andreu Sansó Rosselló andreu.sanso@uib.es	17:00	18:00	Martes	15/09/2015	13/07/2016	DB227

Contextualización

Los contenidos de la asignatura "Econometría" detallan y desarrollan algunos aspectos ya estudiados en la asignatura "Análisis de Datos Económicos", en particular los principios de inferencia estadística, los conceptos de estimador y intervalo de confianza, bien como el procedimiento de contrastación de hipótesis. Para un mejor seguimiento de los contenidos de "Econometría" se aconseja a los estudiantes que revisen esas materias de "Análisis de Datos Económicos" nada más empezar el segundo curso.

El objetivo principal de la asignatura "Econometría" es el estudio detallado de algunas técnicas econométricas comúnmente utilizadas en la investigación aplicada en el ámbito de la economía y de la empresa. La primera parte empieza con el estudio del modelo de regresión lineal simple y su generalización a la regresión múltiple, considerando los métodos de contraste de hipótesis relevantes. La segunda parte se centra en el problema de la especificación del modelo de regresión, en particular los errores de especificación y problemas con la muestra, bien como la incorporación de variables explicativas cualitativas. Finalmente, la tercera parte estudia la validación del modelo.

Requisitos

Un buen conocimiento de los contenidos de la asignatura "Análisis de Datos Económicos" facilitará la comprensión de los contenidos de la asignatura "Econometría".

Competencias

El objetivo fundamental de esta asignatura es el conocimiento por parte de los alumnos de algunas técnicas econométricas comúnmente utilizadas en la investigación aplicada en el ámbito de la economía y de la empresa. Se pretende proporcionar una formación básica en el dominio de las técnicas econométricas como

Guía docente

instrumentos de análisis de datos económicos y empresariales, utilizando cuadros teóricos de otras asignaturas de economía y de empresa, y siendo capaz de interpretar y explicar los resultados obtenidos a la luz de esas teorías. Los métodos y técnicas explicados en esta asignatura serán transponibles para datos económicos y empresariales que los alumnos puedan encontrar en su futuro profesional.

Específicas

- * CE2.1.7 A partir de datos de interés económico-empresarial, ser capaz de aplicar las herramientas estadísticas y econométricas adecuadas para el análisis de la empresa y su entorno.
- * CE2.3.7 Conocer las fuentes de datos estadísticos y económicos relevantes así como las herramientas de análisis adecuadas para preparar la toma de decisiones en empresas y organizaciones, especialmente en los niveles operativo y táctico.
- * CE2.4 Defender las soluciones propuestas de una manera articulada a partir de los conocimientos teóricos y técnicos adquiridos.

Genéricas

- * CG4 Capacidad para usar habitualmente una variada gama de instrumentos de tecnología de la información y las comunicaciones.
- * CG5 (CB3) Tener la capacidad de reunir e interpretar datos relevantes para emitir juicios que incluyan una reflexión sobre temas relevantes de índole social, científica o ética.

Básica

- * Se pueden consultar las competencias básicas que el estudiante tiene que haber adquirido al finalizar el grado en la siguiente dirección: http://estudis.uib.cat/es/grau/comp_basiques/

Contenidos

Contenidos temáticos

Tema 1. Inferencia estadística: Estimación.

- Conceptos básicos.
- Estimación puntual i propiedades deseables de los estimadores.
- Estimación por intervalo.
- Principales estimadores

Tema 2. Inferencia estadística: Contraste de hipótesis

- Especificación de hipótesis
- Estadístico de prueba y criterio de decisión
- Calidad del contraste de hipótesis: tipos de error, potencia y p-valor
- Principales contrastes paramétricos
- Utilización de hojas de cálculo para la inferencia.

Tema 3. El modelo de regresión lineal simple (MRLS)

- Modelización econométrica.
- Correlación lineal y regresión.
- Especificación del MRLS.
- Estimación mínimo-cuadrática.
- Contrastación y evaluación en el MRLS
- Introducción a GRETL y ejercicios prácticos.

Año académico	2015-16
Asignatura	21205 - Econometría
Grupo	Grupo 68, 1S, Menorca, GADE
Guía docente	L
Idioma	Castellano

- Tema 4. El modelo de regresión lineal múltiple (MRLM)
 Especificación del MRLM.
 Estimación del MRLM por MCO.
 Interpretación y evaluación del modelo estimado
 Contrastes de significación individual, conjunta y de un subconjunto de parámetros.
 Predicción.
 Utilización de GRETL y ejercicios prácticos
- Tema 5. El modelo de regresión con variables explicativas cualitativas
 Modelos con una variable cualitativa con una o más categorías.
 Modelos con dos o más variables cualitativas con una o más categorías.
 Interacciones.
 Variables facticias estacionales.
 Utilización de GRETL y ejercicios prácticos
- Tema 6. Verificación del modelo de regresión
 Inclusión de variables superfluas y omisión de variables relevantes.
 No linealidad.
 Cambio estructural usando variables ficticias.
 Incumplimiento de los supuestos básicos sobre el término de perturbación
 Contrastación utilizando GRETL

Metodología docente

Actividades de trabajo presencial

Modalidad	Nombre	Tip. agr.	Descripción	Horas
Clases teóricas	Clases magistrales	Grupo grande (G)	Las clases magistrales dan una exposición detallada de lo más importante en cada tema, sobretodo de conceptos nuevos. Además, tienen una función de enseñar lo más relevante de cada apartado, pero también permitir un enfoque especial en temas más complejos, donde el estudiante en general necesita más apoyo en el proceso de aprendizaje. Otra función importante de las lecciones magistrales es facilitar a los estudiantes ver el contexto de cada tema y poder ver relaciones entre las diferentes partes del curso. Las clases teóricas consisten en 40 horas para cada alumno (en media).	40
Clases prácticas	Sesiones de informática	Grupo mediano (M)	Al finalizar un tema teórico el estudiante realizará sesiones prácticas para asimilar y aplicar la teoría repasada en clase. Las sesiones prácticas se basan en la utilización de una macro econométrica en conjunto con Excel. Aunque las mismas tareas puedan ser realizadas en otros paquetes informáticos, se pretende familiarizar al estudiante con un medio que estará presente en su vida profesional. Las clases prácticas consisten en 16 horas para cada alumno (en media).	13

Año académico	2015-16
Asignatura	21205 - Econometría
Grupo	Grupo 68, 1S, Menorca, GADE
Guía docente	L
Idioma	Castellano

Modalidad	Nombre	Tip. agr.	Descripción	Horas
Evaluación	Cuestionarios tipo test	Grupo mediano (M)	A lo largo del curso, los estudiantes han de resolver de manera individualizada dos cuestionarios tipo test, de unes 10 preguntas, en un tiempo aproximado de 40 minutos cada uno.	1.5
Evaluación	Examen final	Grupo grande (G)	Se realizará un examen global para evaluar todos los conocimientos adquiridos. El examen global tendrá una duración máxima de 2,5 horas.	2.5
Evaluación	Participación en clase	Grupo mediano (M)	Se valorará la participación del estudiante en clase ya sea resolviendo en la pizarra los ejercicios propuestos ya sea respondiendo a las preguntas que el profesor plantee durante el desarrollo de las clases.	
Evaluación	Practicar	Grupo mediano (M)	Los estudiantes han de resolver dos casos prácticos durante el curso en el aula de informática. En el primero, sobre inferencia estadística, lo resolverán mediante el uso de una hoja de cálculo. El segundo, sobre el modelo de regresión, se realizará con el programa Gretl. Al entrar al aula, los estudiantes dispondrán del enunciado y de los datos de la práctica y la resolución de esta se ha de entregar al final de la clase.	3

Al inicio del semestre estará a disposición de los estudiantes el cronograma de la asignatura a través de la plataforma UIBdigital. Este cronograma incluirá al menos las fechas en las que se realizarán las pruebas de evaluación continua y las fechas de entrega de los trabajos. Asimismo, el profesor o la profesora informará a los estudiantes si el plan de trabajo de la asignatura se realizará a través del cronograma o mediante otra vía, incluida la plataforma Campus Extens.

Actividades de trabajo no presencial

Modalidad	Nombre	Descripción	Horas
Estudio y trabajo autónomo individual	Preparación de unidades didácticas	Es recomendable leer el material correspondiente antes de asistir a las clases magistrales para facilitar el aprendizaje del contenido. También es importante revisar el temario después de cada clase para asegurarse que todas las dudas se han solucionado. Estudiar la bibliografía y los recursos ofrecidos por los profesores es importante para profundizar el aprendizaje y ver el contexto de cada apartado en el temario.	90

Riesgos específicos y medidas de protección

Las actividades de aprendizaje de esta asignatura no conllevan riesgos específicos para la seguridad y salud de los alumnos y, por tanto, no es necesario adoptar medidas de protección especiales.

Evaluación del aprendizaje del estudiante

Hay dos itinerarios para superar la asignatura. El itinerario A se basa en la evaluación continua y es el que han de seguir los estudiantes que no son a tiempo parcial y que se matriculan por primera vez en la asignatura. El itinerario B se basa en un único examen final y es opcional tanto para los estudiantes a tiempo parcial como

Guía docente

para los repetidores de la asignatura que hayan presentado como mínimo al 50% de la evaluación continua en algún curso pasado.

La evaluación del aprendizaje del itinerario A consiste en un examen final i tres modalidades diferentes de evaluación continua:

- 1) La primera modalidad de evaluación continua consiste en la resolución de dos cuestionarios tipo test con un peso del 10% cada uno.
- 2) La segunda modalidad de evaluación continua consistirá en la entrega al final de la clase en el aula de informática, de la resolución de dos casos prácticos. El primero será sobre inferencia estadística y se resolverá mediante una hoja de cálculo. El segundo será sobre el modelo de regresión y se resolverá con el programa libre Gretl. El peso de cada práctica en la nota final es del 10%.
- 3) La tercera modalidad de evaluación continua es la participación en clase, ya sea resolviendo ejercicios en la pizarra, ya sea respondiendo a las preguntas que el profesor plantee.
- 4) El examen final es un examen escrito que se realiza en el período de evaluación complementaria y en el período de evaluación extraordinaria. La nota mínima para poder superar la asignatura es de 3.5. El estudiante tendrá una calificación numérica entre 0 y 10 para cada una de las actividades evaluativas. La calificación global se calcula teniendo en cuenta pesos diferentes para las diferentes formas de evaluación. Se considera aprobado el alumno que consiga una nota final mínima de 5, y de 3.5 en el examen final. Un estudiante que no consiga aprobar el curso en el período de evaluación complementaria no puede recuperar las notas de las tareas de evaluación continua se presentará en el período de evaluación extraordinaria a un examen global que representará el 50% de la calificación final.

Cuestionarios tipo test

Modalidad	Evaluación
Técnica	Pruebas objetivas (no recuperable)
Descripción	A lo largo del curso, los estudiantes han de resolver de manera individualizada dos cuestionarios tipo test, de unes 10 preguntas, en un tiempo aproximado de 40 minutos cada uno.
Criterios de evaluación	Son fijados de acuerdo con las competencias requeridas.
Porcentaje de la calificación final:	20% para el itinerario A
Porcentaje de la calificación final:	0% para el itinerario B

Examen final

Modalidad	Evaluación
Técnica	Pruebas de respuesta larga, de desarrollo (recuperable)
Descripción	Se realizará un examen global para evaluar todos los conocimientos adquiridos. El examen global tendrá una duración máxima de 2,5 horas.
Criterios de evaluación	Son fijados de acuerdo con las competencias requeridas.
Porcentaje de la calificación final:	50% para el itinerario A
Porcentaje de la calificación final:	100% para el itinerario B

Guía docente

Participación en clase

Modalidad	Evaluación
Técnica	Pruebas orales (no recuperable)
Descripción	Se valorará la participación del estudiante en clase ya sea resolviendo en la pizarra los ejercicios propuestos ya sea respondiendo a las preguntas que el profesor plantee durante el desarrollo de las clases.
Criterios de evaluación	Resolución correcta de ejercicios y respuesta correcta a las preguntas planteadas por el profesor.

Porcentaje de la calificación final: 10% para el itinerario A

Porcentaje de la calificación final: 0% para el itinerario B

Prácticas

Modalidad	Evaluación
Técnica	Informes o memorias de prácticas (no recuperable)
Descripción	Los estudiantes han de resolver dos casos prácticos durante el curso en el aula de informática. En el primero, sobre inferencia estadística, lo resolverán mediante el uso de una hoja de cálculo. El segundo, sobre el modelo de regresión, se realizará con el programa Gretl. Al entrar al aula, los estudiantes dispondrán del enunciado y de los datos de la práctica y la resolución de esta se ha de entregar al final de la clase.
Criterios de evaluación	Son fijados de acuerdo con las competencias requeridas.

Porcentaje de la calificación final: 20% para el itinerario A

Porcentaje de la calificación final: 0% para el itinerario B

Recursos, bibliografía y documentación complementaria

Bibliografía básica

- ARCARONS, J. y CALONGE, S. (2008), "Microeconometría: introducción y aplicaciones con software econométrico para Excel", Delta Publicaciones.
- HILL, R. C., GRIFFITHS, W.E. y LIM, G. C. (2012), "Principles of Econometrics", Wiley, 4ª edición.
- NOVALES, A. (1996), "Estadística y Econometría". McGraw-Hill.
- WOOLDRIDGE, J. M. (2006), "Introducción a la Econometría: un enfoque moderno", Thomson, 2ª edición.

Bibliografía complementaria

- ASHENFELTER, O., LEVINE, P. B. y ZIMMERMAN, D. J. (2006). "Statistics and Econometrics: methods and applications", Wiley.
- GREENE, W. H. (2007), Análisis Econométrico, Addison-Wesley / Prentice Hall, 6ª edición.
- GUJARATI, D. (2009), "Econometría", McGraw-Hill, 5ª edición.
- KENNEDY, P. (2003), "Introducción a la Econometría", Fondo de Cultura Económica.
- MADDALA, G. S. (1992), "Introducción a la Econometría", Prentice Hall, 2ª edición.
- NEWBOLD P., CARLSON, W. y THORNE, B. (2009), "Estadística para los negocios y la economía", Addison-Wesley / Prentice Hall, 7ª edición.