

| | |
|---------------|-----------------------------|
| Año académico | 2017-18 |
| Asignatura | 21205 - Econometría |
| Grupo | Grupo 68, 1S, Menorca, GADE |
| Guía docente | O |
| Idioma | Castellano |

Identificación de la asignatura

| | |
|-------------------------------|---|
| Nombre | 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 | 16:00 | 17:00 | Martes | 12/09/2017 | 06/03/2018 | 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.

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 instrumentos de análisis de datos económicos y empresariales, utilizando marcos teóricos de otras asignaturas

Guía docente

de economía y de empresa, para así de interpretar y explicar los resultados obtenidos a la luz de esas teorías. Los métodos y técnicas explicados en esta asignatura serán de utilidad 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.

Básicas

- * 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.
- Tema 4. El modelo de regresión lineal múltiple (MRLM)

| | |
|---------------|-----------------------------|
| Año académico | 2017-18 |
| Asignatura | 21205 - Econometría |
| Grupo | Grupo 68, 1S, Menorca, GADE |
| Guía docente | O |
| Idioma | Castellano |

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

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 el estudiante con un medio que estará presente en su vida profesional. Las clases prácticas consisten en 16 horas para cada alumno (en media). | 14 |
| 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 50 minutos cada uno. | 2 |
| 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 | Prácticas | Grupo mediano (M) | Los estudiantes han de resolver un caso práctico durante el curso en el aula de informática sobre el modelo de regresión, que se realizará con el programa Gretl. Al entrar al aula, los estudiantes dispondrán del enunciado y de los datos de la | 1.5 |

| | |
|---------------|-----------------------------|
| Año académico | 2017-18 |
| Asignatura | 21205 - Econometría |
| Grupo | Grupo 68, 1S, Menorca, GADE |
| Guía docente | O |
| Idioma | Castellano |

| Modalidad | Nombre | Tip. agr. | Descripción | Horas |
|-----------|--------|-----------|--|-------|
| | | | práctica y la resolución de esta se ha de entregar al final de la clase. | |

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. Si se supera la evaluación continua no es necesario realizar el examen final, que tendrá carácter de recuperación de la parte de la asignatura referente a las pruebas de evaluación continuada no superadas o no compensadas.

El **itinerario B** se basa en un único examen final y es opcional tanto para los estudiantes a tiempo parcial como para los repetidores de la asignatura que se hayan presentado como mínimo al 50% de la evaluación continua en algún curso pasado.

La evaluación del aprendizaje del **itinerario A** consiste en tres pruebas de evaluación: dos cuestionarios tipo test y una prueba práctica con ordenador mediante el software Gretl.

- * Las tres pruebas de evaluación son recuperables.
- * La materia del curso está dividida en dos bloques: 1) *Inferencia estadística*, que incluye los temas 1 y 2 y pesa un 40% de la nota; y 2) *Modelo de regresión*, que incluye los temas 3 a 5 y pesa un 60% de la nota. Las tres pruebas de evaluación se corresponden con un examen parcial tipo test del primer bloque, que pesa un 40% en la nota final, un parcial tipo test del segundo bloque, que también pesa un 40%, y una prueba práctica en Gretl del segundo bloque, que pesa un 20%.
- * Para aprobar la asignatura la Evaluación Continua (AC) es necesario obtener una media ponderada de los dos bloques 5 y, como mínimo, un 3 de cada una de las 3 pruebas de evaluación.

Guía docente

- * *Bloque 1.* (40% de la nota final) Si se obtiene una nota igual o superior a 5 en el primer parcial, la materia del bloque 1 queda liberada del examen final. Si la nota es inferior a 3 hay que recuperar este bloque en el examen final. Si la nota está entre 3 y 5 se puede compensar con la del segundo bloque, de modo que si la media ponderada de notas de los dos bloques es igual o superior a 5, la asignatura queda aprobada al AC y no hay que ir al examen final.
- * *Bloque 2.* (60% de la nota final) Consta de dos pruebas, un parcial que pesa un 40% en la nota final y una prueba práctica en Gretl que pondera un 20%. Por lo tanto, dentro de este bloque, el parcial representa el 66.7% de la nota y la prueba práctica el 33.3%. Para aprobar el segundo bloque es necesario obtener un mínimo de 3 a cada una de las dos pruebas de evaluación de este bloque. Si no se llega en alguna de las dos pruebas al 3, hay que ir al examen final y recuperar TODA la segunda parte. Si se obtiene una nota igual o superior a 3 en las dos pruebas y la media ponderada del bloque es igual o superior a 5, la materia de este bloque queda liberada del examen final. Si la nota ponderada del bloque está entre 3 y 5 se puede compensar con la del primer bloque, de modo que si la media ponderada de notas de los dos bloques es igual o superior a 5, la asignatura queda aprobada en el AC y no hay que ir al examen final.
- * El examen final es un examen escrito que se realiza en el periodo de evaluación complementaria y en el periodo de evaluación extraordinaria. Tiene carácter de recuperación a los estudiantes del itinerario A, y de examen final para los del itinerario B.

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.

Un alumno será considerado no presentado si se presenta a un número de actividades correspondiente a un porcentaje igual o inferior a 35% de la calificación final. Si presenta una de las justificaciones aceptadas por la UIB (muerte de un familiar de primera línea directa, hospitalización del alumno o su participación en juicio), el alumno puede recuperar la nota de las actividades no presentadas por este motivo. Esta posibilidad sólo existe en los casos descritos y siempre exigirá un comprobante de la situación.

Cuestionarios tipo test

| | |
|--------------------------------------|--|
| Modalidad | Evaluación |
| Técnica | Pruebas objetivas (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 50 minutos cada uno. |
| Criterios de evaluación | Son fijados de acuerdo con las competencias requeridas. |
| Porcentaje de la calificación final: | 80% para el itinerario A con calificación mínima 3 |
| 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: | 0% para el itinerario A |
| Porcentaje de la calificación final: | 100% para el itinerario B con calificación mínima 5 |

Guía docente

Prácticas

| | |
|--------------------------------------|---|
| Modalidad | Evaluación |
| Técnica | Informes o memorias de prácticas (no recuperable) |
| Descripción | Los estudiantes han de resolver un caso práctico durante el curso en el aula de informática sobre el modelo de regresión, que 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 con calificación mínima 3 |
| 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.

