

Plan 465 GRADO EN FINANZAS, BANCA Y SEGUROS

Asignatura 45353 ECONOMETRÍA

Grupo 1

Tipo de asignatura (básica, obligatoria u optativa)

Optativa

Créditos ECTS

6

Competencias que contribuye a desarrollar

G1, G3, G4, G5

E5, E6, E9,E10,E13

T1, T2, T3,T4, T5

Objetivos/Resultados de aprendizaje

Percibir la importancia de la Econometría como instrumento útil para la toma de decisiones en un entorno económico cambiante.

Entender los desarrollos teóricos que conlleva el incorporar la incertidumbre en la modelización de las relaciones entre variables económicas y adecuar las propuestas formales a información empírica disponible.

Aplicar formulaciones teóricas del ámbito econométrico a situaciones prácticas y saber interpretar de forma crítica los resultados obtenidos.

Especificar, estimar y evaluar un modelo econométrico.

Conseguir destrezas en el manejo de software general para el análisis econométrico.

Contenidos

Modelo de regresión lineal clásico: Estimación, contrastes y predicción. Validación del modelo de regresión lineal clásico.

Tema 1: Conceptos fundamentales

1. Concepto de econometría. Modelos económicos y modelos econométricos
2. principio de causalidad en los modelos de regresión
3. Elementos constitutivos de un modelo econométrico
4. Etapas en la elaboración de un modelo econométrico
5. Clasificación de los datos

Tema 2: El modelo de Dos Variables

Tema 3: El modelo de regresión lineal normal clásico

- 1 Especificación del modelo
- 2 Estimación del modelo por Mínimos Cuadrados Ordinarios
- 3 Características de los residuos mínimo cuadrados
- 4 Descomposición de la varianza y Bondad de Ajuste
- 5 Estimación por máxima verosimilitud
- 6 Otras medidas de bondad del ajuste

Tema 4: Contrastes y predicción en el MRLNC

- 1 El Modelo Restringido
- 2 Propiedades del Estimador Restringido
- 3 Contrastes de hipótesis sobre los parámetros. Forma general
- 4 Contrastes de significación individual y conjunta
- 5 Predicción para un valor futuro
- 6 Evaluación de la capacidad predictiva de un modelo

Tema 5: Variables ficticias

- 1 Planteamiento
- 2 Formas de introducir un factor cualitativo en el modelo de regresión
- 3 Formas de introducir varios factores cualitativos en el modelo de regresión

Tema 6: Evaluación del modelo de regresión lineal normal clásico

- 1 El Modelo Particionado
- 2 Errores de especificación en la selección de variables explicativas
- 3 Errores de especificación en la forma funcional. Modelos no lineales
- 4 Contrastes sobre la estabilidad de los parámetros.
- 5 No normalidad

Tema 7: Multicolinealidad

- 1 Multicolinealidad perfecta e imperfecta
- 2 Consecuencias de la multicolinealidad imperfecta
- 3 Procedimientos para detectar la multicolinealidad
- 4 Soluciones a la multicolinealidad

Tema 8: Modelo de Regresión Lineal Normal Generalizado

- 1.- Especificación del modelo
- 2.- Consecuencias de aplicar MCO en un Modelo de Regresión Lineal Generalizado (MRLG)
- 3.- Estimación en el modelo de regresión lineal generalizado
- 4.- Comparación entre estimadores. Contrastes y bondad del ajuste

Principios Metodológicos/Métodos Docentes

Clases teóricas
Clases prácticas
Prácticas en aula o laboratorio
Trabajo individual o grupal no presencial

Criterios y sistemas de evaluación

Pruebas de desarrollo escrito y solución de problemas para la valoración de los contenidos de la asignatura.
Solución de problemas y pruebas de ejecución utilizando herramientas informáticas.
Las pruebas y los criterios para la evaluación de los conocimientos adquiridos por los alumnos a lo largo del curso, dentro de esta asignatura, serán los siguientes:
Se realizará un examen final en las fechas previstas en el calendario de exámenes de la facultad, para cada una de las dos convocatorias (ordinaria y extraordinaria). El examen final, en las dos convocatorias, tendrá un peso del 80% de la calificación final. Este examen tendrá contenido teórico y práctico. Estas dos partes tendrán el mismo peso. La parte práctica se realizará utilizando el programa informático utilizado en clase. No se podrá aprobar la asignatura, si tanto en teoría como en práctica, por separado, no se obtiene al menos un 30% de su puntuación total.
Para la convocatoria extraordinaria, se conservará la calificación obtenida en la evaluación continua.
La calificación final será la máxima de las dos: la obtenida en el examen final y la obtenida ponderando las dos calificaciones (final y evaluación continua, 80% y 20%).

Recursos de aprendizaje y apoyo tutorial

Utilización del programa econométrico Eviews.
Se entregará material docente a través de la plataforma moodle y de la reprografía de la facultad
Horario de tutorías:
<http://www.eco.uva.es/tutorias/>
Los estudiantes concertarán las tutorías con las profesoras, personalmente, o por correo electrónico

Calendario y horario

<http://www.eco.uva.es/infoacad/horarios/GRADOS/eco3.pdf>

Tabla de Dedicación del Estudiante a la Asignatura/Plan de Trabajo

Actividades presenciales
Créditos
Horas
Actividades no presenciales
Créditos
Horas
Clases teóricas (G5, E4, E5,E6,E9,T4
0,6

15
Estudio autónomo individual o en grupo (G2, G3, G5, E6, E7, E8, E9, ,T2,T3, T4, T5, T6)
1,2
30
Clases prácticas (G2, G3, G5, E6, E7, E8, E9, T4, T3)
0,6
15
Elaboración de trabajos y/o prácticas(G2, G3, G4, G5, E6, E7, E8, E9, T1, T3, T4, T5, T6)
1,2
30
Prácticas de laboratorio y/o aulas de informática (G2, G3, G5, E6, E7, E8, E9, T3 T4, T6)
0,6
15
Documentación: consultas bibliográficas, bases de datos, Internet, etc. (G3, G5, E6, E8, E9, T2, T3, T4, T6)
1,2
30
Seminarios y Tutorías (G2, G3, G4, G5, E6, E7, E8, E9, T1, T2, T3, T4, T5, T6)
0,4
10

Otras actividades

Sesiones de evaluación (G2, G3, G4, G5, E6, E8, E9, T1, T3, T4, T5, T6)
0,2
5

Total presencial
2,4
60
Total no presencial
3,6
90

Responsable de la docencia (recomendable que se incluya información de contacto y breve CV en el que aparezcan sus líneas de investigación y alguna publicación relevante)

Jesús Cavero Álvarez (grupo 1): cavero@eco.uva.es
Pilar Zarzosa Espina (grupo 2): pzarzosa@eaee.uva.es

Idioma en que se imparte

Español
