

Plan 468 GRADO EN ECONOMÍA

Asignatura 45724 APLICACIONES DE ECONOMETRÍA

Grupo 1

Tipo de asignatura (básica, obligatoria u optativa)

Optativa

Créditos ECTS

6

Competencias que contribuye a desarrollar

Generales

G1. Poseer y comprender conocimientos básicos de Economía que, partiendo de la base de la Educación Secundaria General, alcancen el nivel propio de los libros de texto avanzados e incluyan también algunos aspectos que se sitúan en la vanguardia de la ciencia económica.

G3. Tener la capacidad de reunir e interpretar datos e información relevante desde el punto de vista económico-empresarial para emitir juicios que incluyan una reflexión sobre temas de índole social, científica o ética.

G4. Poder transmitir (oralmente y por escrito) información, ideas, problemas y soluciones relacionados con asuntos económicos-empresariales, a públicos especializados y no especializados de forma, ordenada, concisa, clara, sin ambigüedades y siguiendo una secuencia lógica.

G5. Poseer las habilidades de aprendizaje necesarias que permitan emprender estudios posteriores con un alto grado de autonomía.

Específicas

E5. Conocer los elementos clave para el asesoramiento científico y técnico en la administración y dirección de empresas y otras organizaciones de acuerdo con las necesidades sociales, los objetivos correspondientes, la legislación vigente y la responsabilidad social de las empresas.

E6. Poseer conocimientos sobre los diferentes métodos cuantitativos y cualitativos para el análisis, evaluación y predicción en la administración y dirección de empresas y otras organizaciones.

E9. Aplicar con rigor la técnica de análisis adecuada en la resolución de problemas en la administración y dirección de empresas y otras organizaciones.

E10. Formular hipótesis y previsiones sobre una idea de negocio y su articulación jurídica, siendo capaz de convertirla en un proyecto empresarial (aprender a emprender).

E13. Evaluar los resultados a los que conducen las diferentes opciones susceptibles de ser puestas en marcha para la resolución de problemas económicos.

Transversales

T1. Capacidad para comunicarse de forma fluida, tanto oral como escrita, en castellano.

T2. Capacidad para leer, comprender y redactar textos en inglés y, en su caso, otros idiomas extranjeros.

T3. Alcanzar las habilidades propias del manejo básico de las Tecnologías de la Información y la Comunicación (TICs).

T4. Demostrar capacidad intelectual para el pensamiento analítico y la interpretación económico-empresarial de documentos, bases de datos e informaciones sociales, así como desarrollar un espíritu crítico ante el saber establecido.

T5. Adquirir la capacidad para trabajar en equipo, demostrando habilidad para coordinar personas y tareas concretas, y contribuyendo con profesionalidad al buen funcionamiento y organización del grupo, sobre la base del respeto mutuo.

Objetivos/Resultados de aprendizaje

- Decidir cuál es la metodología econométrica más adecuada, ante un problema de estimación de un modelo econométrico
- Conocer el tratamiento de diferentes modelos econométricos.
- Especificar, estimar e interpretar los resultados de diferentes modelos econométricos.
- Armonizar el aprendizaje individual con el debate colectivo; trabajar en equipo; realizar aportaciones con espíritu crítico.
- Mostrar destrezas en el manejo de software general para el análisis econométrico.
- Poseer habilidades en la búsqueda de contenidos en el entorno bibliográfico, con la ayuda de las Tecnologías de la Información y de la Comunicación.
- Exponer correctamente sus trabajos, de forma escrita, oral y manejando presentaciones con ayuda de medios audiovisuales.
- Todos estos objetivos irán encaminados al objetivo final de que los estudiantes sepan resolver los problemas prácticos que se encontrarán a la hora de estimar un modelo econométrico con datos reales, específicamente con datos temporales.

Contenidos

INTRODUCCIÓN

Tema 1.- Presentación y comienzo de la asignatura.

- 1.- Introducción a la asignatura.
- 2.- Desarrollo del curso
- 3.- El Modelo de Regresión Lineal Normal Clásico.

BLOQUE 1: APLICACIONES ECONOMETRICAS CON DATOS TEMPORALES. PLANTEAMIENTO Y RESOLUCIÓN DE PROBLEMAS RELACIONADOS CON LOS SIGUIENTES TEMAS:

Tema 2.- Modelo de Regresión Lineal Normal Generalizado.

Tema 3.- Autocorrelación

Tema 4.- Regresores estocásticos

Tema 5.- Modelos Dinámicos

BLOQUE 2: REGRESIÓN CON VARIABLES NO ESTACIONARIAS

Tema 6.- INTRODUCCIÓN A LA REGRESIÓN CON VARIABLES NO ESTACIONARIAS I

- 1.- Introducción al tema.
- 2.- Planteamiento del problema.
- 3.- Datos de corte transversal y datos temporales.
- 4.- Proceso estocástico o Serie temporal.
- 5.- El Proceso Generador de los Datos (PGD).
- 6.- Tendencia determinista y estocástica. Estudio de dos modelos teóricos.

Tema 7.- INTRODUCCIÓN A LA REGRESIÓN CON VARIABLES NO ESTACIONARIAS II

- 1.- Series en niveles y en diferencias.
- 2.- La tendencia determinista como variable explicativa del modelo econométrico.
- 3.- Tratamiento de los efectos estacionales de las series.
- 4.- Series estacionarias y series débilmente dependientes.
- 5.- Regresión espuria.
- 6.- Algunos procesos estocásticos y su condición de estacionariedad.

Tema 8.- PROCEDIMIENTOS PARA ANALIZAR LA ESTACIONARIEDAD

- 1.- Procedimientos Gráficos para analizar la estacionariedad.
- 2.- Contrastes de Raíz Unitaria de Dickey y Fuller.
- 3.- Series estacionarias y series integradas.
- 4.- Test Simple de Dickey y Fuller.
- 5.- Test Aumentado de Dickey y Fuller (ADF).

Tema 9.- COINTEGRACIÓN Y MODELOS DE CORRECCIÓN DE ERROR

- 1.- El concepto de Cointegración.
- 2.- Prueba de Engle y Granger para Cointegración entre dos variables.
- 3.- Modelos de Corrección de Error.
- 4.- Sobre la Cointegración entre varias variables.
- 5.- Resumen final y conclusiones.

Principios Metodológicos/Métodos Docentes

Clases teóricas y prácticas mediante el método "magistral"
Clases teóricas y prácticas mediante métodos participativos y colaborativos.
En los dos casos, prácticas en aula de informática.
Trabajo individual y grupal presencial
Trabajo individual y grupal no presencial
Exposiciones de estudiantes individuales y grupales

Criterios y sistemas de evaluación

Se combinarán distintas estrategias de evaluación, en función del número de alumnos y de su participación continua. El trabajo se evaluará de forma continuada. No obstante, también se utilizarán pruebas objetivas individualizadas.

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
Se utilizarán estrategias docentes participativas y colaborativas, para el desarrollo de la asignatura. Se dará un enfoque muy práctico y aplicado. Desde el primer momento, se simultaneará la clase "magistral" por parte de la profesora, con los trabajos participativos y colaborativos por parte de los estudiantes.
Horario de tutorías:
<http://www.eco.uva.es/tutorias/>
Los estudiantes concertarán las tutorías con los profesores, personalmente, o por correo electrónico

Calendario y horario

Segundo semestre
<http://www.eco.uva.es/horarios/>

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

ACTIVIDADES PRESENCIALES

HORAS

ACTIVIDADES NO PRESENCIALES

HORAS

Clases teóricas

15

Estudio y trabajo individual o en Grupo

50

Clases prácticas

5

Laboratorios

25

Documentación: Consultas bibliográficas, Internet...

40

Prácticas externas, clínicas o de campo

Tutorías personalizadas y seminarios

10

Evaluación y otras actividades

5

Total presencial

60

Total no presencial

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)

Pilar Zarzosa Espina
pzarzosa@eae.uva.es

Idioma en que se imparte

Castellano
