

**Proyecto/Guía docente de la asignatura**

Asignatura	Econometría II		
Materia	Econometría		
Módulo			
Titulación	Derecho, Administración y Dirección de Empresas		
Plan	482	Código	46400
Periodo de impartición	S8	Tipo/Carácter	OB
Nivel/Ciclo	Grado	Curso	4
Créditos ECTS	3		
Lengua en que se imparte	Castellano		
Profesor/es responsable/s	Jesús Cavero Álvarez		
Datos de contacto (E-mail, teléfono...)	cavero@eco.uva.es		
Departamento	Economía Aplicada		

1. Situación / Sentido de la Asignatura**1.1 Contextualización**

Esta asignatura pretende proporcionar una formación sobre las distintas técnicas de estimación y predicción más utilizadas, con el fin de servir de herramienta para el análisis y la investigación aplicada en la economía y la administración de empresa .

La asignatura tiene un marcado carácter instrumental y por ello es fundamental su interrelación con otras asignaturas de la titulación, de forma que sus contenidos se puedan aplicar en el ámbito de la empresa. Su ubicación en el plan de estudios favorece este objetivo, al impartirse en el cuarto curso (octavo semestre) del grado.

Por otro lado, hay que tener en cuenta que los alumnos ya disponen de conocimientos previos en las materias de Estadística y Econometría, estudiados en semestres anteriores, de forma que se pretende conseguir, a partir de los conocimientos adquiridos previamente, la comprensión de nuevas técnicas econométricas enfocadas al tema de la estimación y predicción.

1.2 Relación con otras materias

Materia instrumental y complementaria del análisis económico y empresarial



1.3 Prerrequisitos

Es imprescindible poseer los conocimientos impartidos en Econometría I

2. Competencias

G2,G3,G4,G5, E4,E5,E6,E7,E8,E9,E10,E11,T1,T2,T3,T4,T5,T6

2.1 Generales

G2. Saber aplicar los conocimientos adquiridos a su trabajo de forma profesional, y poseer las competencias que suelen demostrarse mediante la elaboración y defensa de argumentos y la resolución de problemas de carácter económico-empresarial.

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.

2.2 Específicas

E4 Conocer los instrumentos y herramientas disponibles, así como sus ventajas e inconvenientes, para diseñar políticas y estrategias empresariales en el ámbito general de la organización o en cuanto a financiación e inversión, operaciones, capital humano y comercialización, a la vez que comprender sus efectos sobre los objetivos empresariales y el reflejo contable de sus resultados.

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.

E7. Administrar una empresa u organización de pequeño tamaño, o un departamento en una empresa u organización de mayor dimensión, tanto en el ámbito del sector privado como en el marco del sector público, logrando una adecuada posición competitiva e institucional y resolviendo los problemas más habituales en su dirección y gestión.

E8. Recopilar e interpretar diversas fuentes de información (bibliográficas, estadísticas, etc.) mediante diferentes herramientas.

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).

E11. Redactar proyectos y planes de dirección global o referidos a áreas funcionales de las organizaciones, incluyendo, en su caso, propuestas de mejora.



2.3 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.
- T6. Gestionar de forma eficiente el tiempo, así como planificar y organizar los recursos disponibles estableciendo prioridades y demostrando capacidad para adoptar decisiones y afrontar dificultades cuando éstas aparezcan.

3. Objetivos

- Aplicar la metodología econométrica al análisis de relaciones entre variables económicas cuyo comportamiento está sometido a incertidumbre.
- Tratar adecuadamente las peculiaridades de los modelos dinámicos, en los que el presente se explica a través de la evolución de la realidad económica.
- Afrontar el análisis de relaciones entre variables económicas observadas a lo largo del tiempo, para las que no se cumplen los supuestos estadísticos generales, debido al comportamiento característico de gran parte de los procesos económicos temporales.
- Predecir el comportamiento de las variables económicas utilizando técnicas de series temporales.
- 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.



4. Contenidos y/o bloques temáticos

Bloque 1:

Carga de trabajo en créditos ECTS:

a. Contextualización y justificación

Esta asignatura pretende proporcionar una formación sobre las distintas técnicas de estimación y predicción más utilizadas, con el fin de servir de herramienta para el análisis y la investigación aplicada en la economía y la administración de empresas.

La asignatura tiene un marcado carácter instrumental y por ello es fundamental su interrelación con otras asignaturas de la titulación, de forma que sus contenidos se puedan aplicar en el ámbito de la empresa. Su ubicación en el plan de estudios favorece este objetivo, al impartirse en el cuarto curso (octavo semestre) del grado.

Por otro lado, hay que tener en cuenta que los alumnos ya disponen de conocimientos previos en la materia de Estadística y Econometría, estudiados en tres semestres anteriores, de forma que se pretende conseguir, a partir de los conocimientos adquiridos previamente, la comprensión de nuevas técnicas econométricas enfocadas al tema de la estimación y predicción.

b. Objetivos de aprendizaje

Aplicar la metodología econométrica al análisis de relaciones entre variables económicas cuyo comportamiento está sometido a incertidumbre.

Tratar adecuadamente las peculiaridades de los modelos dinámicos, en los que el presente se explica a través de la evolución de la realidad económica.

Afrontar el análisis de relaciones entre variables económicas observadas a lo largo del tiempo, para las que no se cumplen los supuestos estadísticos generales, debido al comportamiento característico de gran parte de los procesos económicos temporales.

Predecir el comportamiento de las variables económicas utilizando técnicas de series temporales.

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.

c. Contenidos

Modelo de Regresión Generalizado: Heteroscedasticidad y Autocorrelación, Modelos Dinámicos. Predicción con Series temporales: Modelos ARIMA

d. Métodos docentes

Clase magistral

Exposición del contenido de cada tema a través de presentaciones en pantalla que estarán disponibles para el alumno con antelación.

Clases prácticas en aula y laboratorio

Realización de problemas sobre el contenido teórico y sobre temas concretos de especial relevancia.

Resolución en el Laboratorio de informática de problemas y casos relacionados con el contenido teórico o temas de especial relevancia



e. Plan de trabajo

En líneas generales, el plan de trabajo se desarrollará de la siguiente manera:

- Se comenzará con unas **clases magistrales de teoría** que expliquen los fundamentos teóricos, en los que se darán las pautas que tienen que seguir los alumnos para su posterior estudio y se les motivará para que expongan sus comentarios y sus dudas.
- Se realizarán **clases prácticas en aula** en las que se utilizarán los métodos de aprendizaje basado en problemas y el análisis de casos. Para ello, se resolverán cuestiones, con la finalidad de que los alumnos asimilen y afiancen los conocimientos adquiridos y aprendan a aplicarlos a distintas situaciones y enunciados.
- Se impartirán **clases prácticas de laboratorio** en el aula de informática, utilizando el software econométrico Eviews. Se pretende que los alumnos aprendan a resolver un problema econométrico, aplicando las técnicas desarrolladas en las clases de aula convencional.

f. Evaluación

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 100% de la calificación final. Este examen tendrá contenido teórico y práctico. 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.

g. Bibliografía básica

Teoría

GUJARATI, D. N. Y PORTER, D. C. (2010): Econometría. Quinta edición. McGraw-Hill. México D. F.

MATILLA GARCÍA, M., PÉREZ PASCUAL, P. y SANZ CARNERO, B. (2013): Econometría y Predicción. McGraw-Hill. Madrid.

URIEL E. Y PEIRO A. (2000) Introducción al análisis de series temporales. Ed AC

Práctica

CARRASCAL ARRANZ, U. y otros (2000), Análisis Econométrico con Eviews. Ed. Ra-Ma.

PENA, B. y otros (1999). Cien Ejercicios de Econometría. Ed. Pirámide

h. Bibliografía complementaria

FERNÁNDEZ SÁINZ, A. y otros. (2005) Ejercicios de Econometría. Segunda Edición. Ed. McGraw-Hill.

GREENE, W. H. (1999): Análisis Econométrico. Tercera edición. Prentice Hall. Madrid.

GUJARATI D. (2011): Econometrics by example. Ed. Palgrave Macmillan

JOHNSTON, J. y DINARDO, J. (2001): Métodos de Econometría Vicens Vives.

PÉREZ, C (2006): Econometría de las series temporales. Prentice Hall, Madrid.

WOOLDRIDGE, J. (2006): Introducción a la Econometría. Un enfoque moderno. Segunda edición. Thomson, Madrid.

DIEBOLD F.(1999) Elementos de pronósticos. Thomson Ed.



i. Recursos necesarios

Pizarra estándar, cañón de proyección, ordenador, software de presentación y econométrico, pizarra digital, campus virtual para material de temas y tutorías

j. Temporalización

CARGA ECTS	PERIODO PREVISTO DE DESARROLLO
3	15 semanas

5. Métodos docentes y principios metodológicos

Clase magistral

Exposición del contenido de cada tema a través de presentaciones en pantalla que estarán disponibles para el alumno con antelación.

Clases prácticas en aula y laboratorio

Realización de problemas sobre el contenido teórico y sobre temas concretos de especial relevancia.

Resolución en el Laboratorio de informática de problemas y casos relacionados con el contenido teórico o temas de especial relevancia



**6. Tabla de dedicación del estudiante a la asignatura**

ACTIVIDADES PRESENCIALES	HORAS	ACTIVIDADES NO PRESENCIALES	HORAS
Clases teóricas y prácticas	18	Estudio y trabajo individual o en Grupo	40
Laboratorios	10	Documentación: Consultas bibliográficas, Internet....	5
Evaluación y otras actividades	2		
Total presencial	30	Total no presencial	45

7. Sistema y características de la evaluación

INSTRUMENTO/PROCEDIMIENTO	PESO EN LA NOTA FINAL	OBSERVACIONES
Examen final	100%	Este examen tendrá contenido teórico y práctico. 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

8. Consideraciones finales