

**Proyecto docente de la asignatura**

Asignatura	Econometría II		
Materia	Econometría		
Módulo			
Titulación	Grado en Economía		
Plan	468	Código	45688
Periodo de impartición	S6	Tipo/Carácter	OB
Nivel/Ciclo	Grado	Curso	3
Créditos ECTS	6		
Lengua en que se imparte	Castellano		
Profesor/es responsable/s	Pilar Zarzosa Espina		
Datos de contacto (E-mail, teléfono...)	pzarzosa@eae.uva.es		
Horario de tutorías	http://www.eco.uva.es/tutorias/ No obstante, cada estudiante deberá concertar las tutorías con las profesoras, personalmente, o por correo electrónico.		
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.

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 economía y las ciencias sociales. Su ubicación en el plan de estudios favorece este objetivo, al impartirse en el tercer curso (quinto semestre) del grado.

Específicamente, partiendo de los conocimientos previos adquiridos en las materias de Estadística y Econometría, durante los semestres anteriores, se profundiza en ellos y se introducen nuevas técnicas econométricas enfocadas a abordar los problemas que surgen a la hora de aplicar los métodos econométricos a los datos reales, con especial énfasis en los datos de series temporales. De manera que se guía a los estudiantes hasta que son capaces de comprender y aplicar las aportaciones de los dos grandes econométricos, y premios Nobel (2003), Engle y Granger, a este campo de las relaciones entre series económicas reales.

1.2 Relación con otras materias

Materia instrumental y complementaria del análisis económico, empresarial, de mercados y financiero.

1.3 Prerrequisitos

Se recomienda tener conocimientos previos de Estadística I, Estadística II y Econometría I.

2. Competencias

G1, G3, G4, G5, E5, E6, E9, E10, E13 T1, T2, T3, T4, T5



2.1 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.

2.2 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

2.3 Transversales

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

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.

3. Objetivos

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.

Mostrar destrezas en el manejo de software general para el análisis econométrico. Programa Eviews.



Entender la modelización de las relaciones entre variables económicas y la adecuación de las propuestas formales a la información empírica disponible.

Aplicar la metodología econométrica a situaciones prácticas y saber interpretar de forma crítica los resultados obtenidos.

Conjugar el razonamiento formal con juicios de valor, de forma ordenada, concisa y clara, relacionando el establecimiento de hipótesis, su contrastación y los fundamentos económicos.

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.

4. Contenidos

Modelización con datos transversales y temporales. Análisis de regresión con series temporales. Autocorrelación. Regresores estocásticos. Modelos dinámicos. Regresión con variables no estacionarias Cointegración y Modelos de corrección de error.

5. Métodos docentes y principios metodológicos

Clases teóricas y prácticas mediante el método “magistral”

Prácticas en aula de informática, donde cada estudiante usará un ordenador. Programa Eviews.

Trabajo individual y grupal presencial y no presencial

Se dará un enfoque muy práctico y aplicado y se motivará la participación de los estudiantes para el desarrollo de la asignatura.

Se usarán los recursos disponibles: Pizarra estándar, cañón de proyección, ordenador, software de presentación y econométrico Eviews, pizarra digital, campus virtual de la Uva, espacios para tutorías individuales y grupales. Aulas de informática, donde cada estudiante dispondrá de un ordenador. Materiales didácticos.

Material didáctico para el estudio de la asignatura:

Los temas que integran el Programa pueden prepararse por cualquiera de los manuales que aparecen recogidos en la bibliografía básica y en la bibliografía complementaria.

Con objeto de facilitar a los alumnos el seguimiento de las clases se prepara Material Docente. Dicho material se deposita en el Servicio de Reprografía de la Facultad, y se cuelga en el campus virtual de la Uva (Moodle), donde se cuelgan otros recursos docentes.

6. Tabla de dedicación del estudiante a la asignatura

ACTIVIDADES PRESENCIALES	HORAS	ACTIVIDADES NO PRESENCIALES	HORAS
Clases teóricas	15	Estudio y trabajo individual o en Grupo	50
Clases prácticas	15		
Laboratorios	15	Resolución de ejercicios y cuestiones.	20
Prácticas externas, clínicas o de campo		Documentación: Consultas bibliográficas, Internet....	20



Tutorías personalizadas y seminarios	10		
Evaluación y otras actividades	5		
Total presencial	60	Total no presencial	90

7. Sistema y características de la evaluación

INSTRUMENTO/PROCEDIMIENTO	PESO EN LA NOTA FINAL	OBSERVACIONES
Examen final establecido en la fecha oficial, para evaluar la comprensión del contenido total de la asignatura, así como las competencias relacionadas con la aplicación de las técnicas estudiadas tanto en teoría como en práctica	80%	El examen final incluirá una parte teórica y otra práctica, realizada utilizando el programa econométrico Eviews. Los pesos de ambas partes serán 50% y 50% respectivamente. Para aprobar este examen, es necesario alcanzar, al menos, un 30% de la puntuación de cada una de las partes. Si no se alcanza esa puntuación mínima en cada parte, la calificación final será el mínimo entre la media ponderada resultante y un 4; es decir, no se podrá obtener una calificación superior a 4.
Valoración del trabajo realizado durante el desarrollo de la asignatura:	20%	Durante el curso, se realizará una prueba de conocimientos para motivar al estudiante al trabajo continuado de la asignatura y para ayudarlo a autoevaluar su rendimiento.
Calificación final		La calificación final será la máxima entre las dos siguientes: -Calificación del examen final (en este caso, la calificación del examen final constituirá el 100% de la calificación final); -Calificación resultante de ponderar las dos calificaciones (80% y 20%).

En la convocatoria extraordinaria se utilizará el mismo sistema de evaluación. Las fechas previstas para la realización de los exámenes se pueden consultar en <http://www.eco.uva.es/examenes/>

8. Consideraciones finales

g.1 Bibliografía básica

https://buc-uva.alma.exlibrisgroup.com/leganto/public/34BUC_UVA/lists/5248929200005774?auth=SAML§ion=5248929210005774

STOCK, J. y M. WATSON (2012): *Introducción a la econometría*. Ed. Pearson

Matilla García, M., Pérez Pascual, P. y Sanz Carnero, B. (2017): *"Econometría y Predicción"*. McGraw-Hill. Madrid.

Gujarati, D. N. y Porter, D. C. (2010): *"Econometría. Quinta edición"*. McGraw-Hill. México D. F.

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

HILL R.C., GRIFFITHS W.E. Y LIM G.C. (2012) *Principles of Econometrics 4ª ed. International Student version*. Wiley & Sons

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

Carrascal, U., González, Y. y Rodríguez, B. (2000): *"Análisis Econométrico con Eviews"*. Ed. Ra-ma, Madrid.

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



PÉREZ, C. (2006): Problemas resueltos de Econometría. Thomson, Madrid.

g.2 Bibliografía complementaria

https://buc-uva.alma.exlibrisgroup.com/leganto/public/34BUC_UVA/lists/5248929200005774?auth=SAML§ion=5248929330005774

Davidson, R. y Mackinnon, J. G. (1993): "Estimation and Inference in Econometrics". Oxford University Press, New York.

Alonso, A.; Fernández, J.; Gallastegui, I. (2005): "Econometría" Pearson Educación, Madrid.

Greene, W. H. (1999): "Análisis Económico". Tercera edición. Prentice Hall. Madrid.

Johnston, J. y Dinardo, J. (2001): "Métodos de Econometría" Vicens Vives.

Pindyck, R. S. And Rubinfeld, D. L. (2001): "Econometría. Modelos y pronósticos Cuarta edición". McGraw-Hill, Madrid.

PÉREZ, C. (2008): Econometría Avanzada. Técnicas y Herramientas. Pearson. Prentice Hall.

PÉREZ MARÍA "Econometría Avanzada con Eviews. Conceptos y ejercicios resueltos".

PÉREZ CÉSAR (2006) "Econometría de las series temporales". Ed. Pearson.

González-Rivera, G. (2013): Forecasting for economics and business. Routledge, London.

Singularización para el curso 2021-2022:

La modalidad de docencia, presencial o bimodal, dependerá de la situación sanitaria vigente. Adicionalmente, las tutorías se desarrollarán de forma individual y también en grupo, y podrán ser presenciales o por videoconferencia (online) según lo permita la situación.