

Econometría**2015/2016**

Código: 102105

Créditos ECTS: 6

Titulación	Tipo	Curso	Semestre
2501231 Contabilidad y Finanzas	OB	3	1

Contacto

Nombre: Maria Teresa Cabeza Gutes

Correo electrónico: Maite.Cabeza@uab.cat

Uso de idiomas

Lengua vehicular mayoritaria: catalán (cat)

Prerequisitos

Es altamente recomendable que el estudiante haya superado satisfactoriamente Matemáticas I, II y Estadística I y II. Haber asimilado los contenidos de estas asignaturas es imprescindible para poder seguir con éxito la Econometría I.

Objetivos y contextualización

La asignatura *Econometría* presenta las herramientas básicas para el análisis empírico de relaciones entre variables económicas. El curso empieza con el modelo de regresión simple, presentado en la asignatura de Estadística II, y se extiende al modelo de regresión múltiple, considerando tanto variables explicativas cuantitativas como cualitativas.

El objetivo es que el estudiante aprenda a extraer información de datos económicos utilizando el modelo de regresión lineal básico, sabiendo valorar con rigor sus ventajas y limitaciones. Se pondrá especial énfasis en que el estudiante asimile, de la forma más intuitiva posible, los aspectos teóricos del análisis econométrico. A lo largo del curso se presentarán numerosas aplicaciones, trabajando con datos reales y software econométrico, con el objetivo de que el estudiante valore los aspectos prácticos de las herramientas presentadas.

Competencias

- Aplicar la metodología econométrica adecuada para dar respuesta a los problemas que aparecen en el estudio empírico de algunos datos económicos.
- Capacidad de comunicación oral y escrita en catalán, castellano e inglés, que permita sintetizar y presentar oralmente y por escrito el trabajo realizado.
- Capacidad de seguir estudiando en el futuro de forma autónoma, profundizando los conocimientos adquiridos o iniciándose en nuevas áreas de conocimiento.

Resultados de aprendizaje

1. Analizar el comportamiento de series temporales económicas y hacer predicciones.
2. Capacidad de comunicación oral y escrita en catalán, castellano e inglés, que permita sintetizar y presentar oralmente y por escrito el trabajo realizado.
3. Capacidad de seguir estudiando en el futuro de forma autónoma, profundizando los conocimientos adquiridos o iniciándose en nuevas áreas de conocimiento.
4. Especificar de modelos, métodos de estimación e inferencia.
5. Identificar y aplicar la metodología econométrica adecuada para dar respuesta a los problemas que aparecen en el estudio empírico de algunos datos económicos.

6. Preparar los datos obtenidos de las fuentes para el posterior análisis cuantitativo.
7. Utilizar información económica procedente de diversas fuentes: Bases de datos, Internet, etc.
8. Utilizar programas informáticos para el análisis cuantitativo de los datos.

Contenido

Tema 1: Introducción al análisis econométrico

- ¿Qué es la econometría? Objetivos.
- Naturaleza y estructura de los datos económicos.
- Causalidad versus correlación.

Tema 2: El modelo de regresión simple

- El modelo de regresión simple. La recta de regresión.
- Estimación por mínimos cuadrados ordinarios. La recta ajustada.
- Bondad del ajuste. El coeficiente de determinación.
- Propiedades numéricas del estimador.
- Distribución del estimador
- Propiedades estadísticas del estimador
- Aplicaciones.

Tema 3: El modelo de regresión lineal múltiple: estimación

- El modelo de regresión múltiple.
- Estimación por mínimos cuadrados ordinarios. El modelo ajustado.
- El coeficiente de determinación y el coeficiente de determinación ajustado.
- Modelo de regresión y forma funcional.
- Distribución y propiedades del estimador.
- Los componentes de la varianza del estimador.
- Estimación bajo la presencia de colinealidad.
- Aplicaciones.

Tema 4: El modelo de regresión múltiple: inferencia

- Contraste de hipótesis con el estadístico t. Test de significación individual.
- Intervalos de confianza de un parámetro.
- Contraste de hipótesis con el estadístico F.
- El estadístico F vía el estimación restringida. Test de significación global.
- Variables ficticias. Test de cambio estructural.
- Inferencia bajo la presencia de colinealidad.
- Aplicaciones.

Metodología

Las actividades que tiene que seguir el estudiante para poder asimilar correctamente los contenidos de esta asignatura son las siguientes:

1. Clases teóricas

En las llamadas clases teóricas, el profesor presentará los principales conceptos y métodos. Esta presentación irá a menudo acompañada de ejemplos para facilitar el aprendizaje del material expuesto.

2. Clases en el aula de informática

Para una mejor asimilación de los conceptos presentados se realizarán clases en las aulas de informática. El software econométrico que apoyará a estas clases será principalmente Gretl, software de libre acceso ya utilizado en la asignatura de Estadística II. El estudiante se familiarizará con nuevos aspectos de este software, como es el uso de opciones adicionales de sus menús o la utilización de guiones de instrucciones.

3. Clases de resolución de problemas

Cada tema tendrá asociado una lista de problemas que los estudiantes tendrán que trabajar por su cuenta, a nivel individual o en grupo. Esta actividad es crucial para que el estudiante asimile los aspectos teóricos y valore la aplicación de las herramientas presentadas. El profesor seleccionará algunos de los ejercicios de las listas para ser discutidos en clase. Esta actividad tiene como objetivo comentar y resolver dudas que hayan podido surgir en algunos de los ejercicios y aplicaciones. El profesor podrá utilizar algunas de las clases de resolución de ejercicios como actividad de evaluación.

4. Tutorías presenciales

El alumno dispondrá de unas horas donde el profesor de la asignatura podrá resolver dudas puntuales. El horario específico de estas tutorías se podrá consultar en el Campus Virtual o la web del propio profesor.

5. Estudio

Las actividades anteriores ocupan sólo un tercio del tiempo que el estudiante tiene que dedicar a esta asignatura. El resto está ocupado por el trabajo autónomo del propio estudiante (estudio, consulta de los manuales de referencia, resolución de problemas y aplicaciones o prácticas con el software indicado). El trabajo individual del estudiante es un elemento puntal por la asimilación de la materia.

Importante:

- Para poder superar con éxito el curso el estudiante tiene que asistir al 100% de las clases.
- Por el buen funcionamiento de la clase: No se puede llegar tarde, ni entrar ni salir del aula durante la clase.

Actividades

Título	Horas	ECTS	Resultados de aprendizaje
Tipo: Dirigidas			
Resolución de ejercicios en clase	15	0,6	1, 4, 5, 6, 7, 8
Teóricas	30	1,2	1, 4, 5, 8
Tipo: Supervisadas			
Clases en el aula de informática	7	0,28	1, 5, 6, 7, 8
Tipo: Autónomas			
Estudio y resolución de ejercicios	90	3,6	1, 4, 5, 6, 2, 7, 8

Evaluación

La evaluación del alumno se realizará en función de los resultados de las siguientes actividades:

1. Un examen parcial

En esta prueba escrita se evaluará al estudiante sobre el contenido del Tema 1 y 2. Durante la prueba no se permitirá consultar ningún tipo de material. Esta prueba NO libera materia. La nota vendrá dada sobre 10. Esta prueba representa el 20% de la nota del curso.

2. Un examen final

El examen final tiene como objetivo valorar si el estudiante ha logrado los principales contenidos de la asignatura. En esta prueba escrita se evaluará al estudiante sobre el contenido del Tema 1, 2, 3 y 4. Durante la prueba no se permitirá consultar ningún tipo de material. La nota vendrá dada sobre 10. Esta prueba representa el 70% de la nota del curso.

3. Ejercicios

Los estudiantes realizarán de forma ocasional ejercicios para su evaluación. El profesor puede pedir a los estudiantes que la realización de estos ejercicios durante el horario de clase. La nota vendrá dada sobre 10. La nota de los ejercicios representa el 10% de la nota del curso.

Criterios de evaluación:

a. Una vez publicadas las calificaciones del examen final, se publicará también la nota del curso. Tal como se ha indicado, la nota del curso viene dada por:

$$\text{NOTA CURSO} = + 0,1 * \text{EJERCICIOS} + 0,2 * \text{PARCIAL} + 0,7 * \text{FINAL}$$

b. La asignatura se considera superada si la nota del curso es igual o superior a 5.

c. Un estudiante que no se presenta a ninguna prueba evaluatoria se considera como no evaluable.

d. Los estudiantes deben respetar las fechas de realización de las pruebas de evaluación. En ningún caso se realizaran pruebas fuera de las fechas marcadas.

Calendario de evaluación

Las fechas de los exámenes vienen marcadas por el calendario de exámenes de la facultad.

Publicación y revisión de calificaciones

Después de cada actividad de evaluación se publicarán las calificaciones en el Campus Virtual o en la web del propio profesor. Del mismo modo, se informará del procedimiento, lugar, fecha y hora de la revisión de exámenes de acuerdo con la normativa vigente.

Reevaluación

Para aquellos estudiantes que en la evaluación hayan obtenido una nota que sea igual o superior a 4 e inferior a 5 habrá una re-evaluación. Esta reevaluación estará programada en el calendario de exámenes de la Facultad. La nota de la reevaluación será cualitativa y solo tiene dos posibles calificaciones: APTO o NO APTO. Si el estudiante obtiene una nota de APTO se considera que ha superado la asignatura con una nota numérica máxima igual a 5. Si el estudiante obtiene una nota de NO APTO, no supera la asignatura y la nota final será igual a la nota obtenida antes de la reevaluación.

Código de honor:

Sin perjuicio de otras medidas disciplinarias que se estimen oportunas, y, de acuerdo con la normativa académica vigente, si un estudiante realiza actividades irregulares durante la prueba de evaluación, esta se calificará con un cero. Así pues, copiar o dejar copiar una práctica o cualquier actividad de evaluación implicará suspender con un cero, y si es una actividad necesaria para aprobar, toda la asignatura quedará suspendida. No serán recuperables las actividades de evaluación calificadas de esta forma en el mismo curso académico.

Actividades de evaluación

Título	Peso	Horas	ECTS	Resultados de aprendizaje
Ejercicios	10	4	0,16	1, 3, 4, 5, 6, 2, 7, 8
Exámenes (Parcial, Final)	90	4	0,16	1, 3, 4, 5, 2, 8

Bibliografía

Llibros de texto:

-Wooldridge, J. M., *Introductory Econometrics: A Modern Approach*. South-Western Cengage learning. 5ed. 2013. Última versión en castellano: Introducción a la Econometría, Cengage Learning editores, 4a ed.

-Uriel Jiménez, E., *Introducción a la Econometría*. Libro electrónico. Universidad de Valencia.