

Guía docente de la asignatura

Econometría

Fecha última actualización: 18/06/2021

Fecha de aprobación: 18/06/2021

Grado	Grado en Marketing e Investigación de Mercados	Rama	Ciencias Sociales y Jurídicas				
Módulo	Métodos Cuantitativos	Materia	Econometría				
Curso	3º	Semestre	1º	Créditos	6	Tipo	Obligatoria

PRERREQUISITOS Y/O RECOMENDACIONES

Se recomienda tener adquiridos los conocimientos de Matemáticas, de Estadística y Economía del Módulo de Formación básica.

BREVE DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS (Según memoria de verificación del Grado)

- Introducción.
- El papel de la Econometría.
- El modelo de regresión lineal clásico.
- Supuestos Inferencia y predicción.
- Multicolinealidad.
- Heterocedasticidad.
- Autocorrelación.
- Modelos de Elección discreta.
- Modelos con Variables Retardadas.
- Modelos de Datos de Panel. Efectos fijos. Efectos Aleatorios.
- Modelos de Ecuaciones Simultáneas. Identificación y Métodos de Estimación.
- Modelos no lineales. Aproximaciones lineales. Algoritmos de Optimización.

COMPETENCIAS ASOCIADAS A MATERIA/ASIGNATURA

COMPETENCIAS GENERALES

- CG01 - Capacidad para el análisis crítico y la síntesis
- CG06 - Habilidades de gestión de la información (habilidad para buscar y analizar información proveniente de diversas fuentes)

COMPETENCIAS ESPECÍFICAS



- CE07 - Conocer y ser capaz de aplicar las herramientas básicas de naturaleza cuantitativa para el diagnóstico y análisis empresarial
- CE24 - Capacidad para cuantificar relaciones de comportamiento entre variables
- CE25 - Capacidad para complementar los conocimientos de econometría con las situaciones de incumplimiento de hipótesis específicas del modelo de regresión
- CE26 - Conocer las técnicas más usuales para la construcción de modelos
- CE27 - Capacidad para extender el modelo de regresión a modelos de datos de panel, de elección discreta y de variable dependiente limitada

COMPETENCIAS TRANSVERSALES

- CT01 - Capacidad para analizar y comprender las fuerzas del mercado que influyen en las actividades comerciales y para valorar críticamente situaciones empresariales.

RESULTADOS DE APRENDIZAJE (Objetivos)

- Detectar y resolver problemas de multicolinealidad en el modelo lineal general.
- Especificar y estimar relaciones no lineales en modelos de regresión.
- Especificar y estimar modelos con variables dependientes discretas e interpretar los resultados.
- Plantear, seleccionar y estimar modelos con datos longitudinales de corte transversal y temporales.
- Identificar y estimar un modelo de ecuaciones simultáneas a partir de la información muestral.

PROGRAMA DE CONTENIDOS TEÓRICOS Y PRÁCTICOS

TEÓRICO

- Tema 1. Introducción a la Econometría.
 1. Econometría y modelos econométricos.
 2. Fases del método econométrico y componentes de un modelo econométrico.
 3. Naturaleza de la información utilizada en Econometría.
- Tema 2. El modelo lineal I.
 1. Hipótesis del modelo.
 2. Estimación de los parámetros del modelo por mínimos cuadrados ordinarios. Propiedades.
 3. Bondad de ajuste: coeficientes de determinación y criterios de Akaike y Schwarz.
- Tema 3. El modelo lineal II.
 1. Estimación mediante intervalos de confianza de los parámetros del modelo.
 2. Contrastes de hipótesis acerca de los parámetros del modelo.
 3. Explotación del modelo.
- Tema 4. Multicolinealidad.
 1. Concepto, causas y consecuencias.
 2. Procedimientos de detección de multicolinealidad en la muestra.
 3. Soluciones al problema de la multicolinealidad.
- Tema 5. Heteroscedasticidad.
 1. Concepto, causas y consecuencias.
 2. Procedimientos de detección: contrastes de Goldfeld-Quandt, de Breusch-Pagan



- y de Glejser.
- 3. Estimación de modelos con heteroscedasticidad.
- Tema 6. Autocorrelación
 - 1. Concepto, causas y consecuencias.
 - 2. Procedimientos de detección: prueba h de Durbin y contrastes de Durbin-Watson y de Ljung-Box.
 - 3. Estimación de modelos con perturbaciones autocorrelacionadas.

PRÁCTICO

Coincide con el teórico con la salvedad de que, en el tema 2, se incluyen ejercicios de estimación de modelos utilizando variables ficticias.

BIBLIOGRAFÍA

BIBLIOGRAFÍA FUNDAMENTAL

- Alonso, A.; Fernández, J. y Gallastegui, I. (2005).- Econometría. Ed. Prentice Hall.
- [Martín](#), G.; Labeaga, J.M. y Mochón, F. (1997).- Introducción a la Econometría. Prentice Hall
- Palacios, F.; García, R.M. y Herrerías, J.M. (2011).- Ejercicios de Econometría 1. Ediciones Pirámide.
- [Sánchez](#), C.; López, M.M. y García, MT. (2015). Econometría. Ed. Fleming.
- Stock, J.H. y Watson, M.M. (2012) Introducción a la Econometría, 3ª ed. Pearson.
- Wooldrige, J.M. (2010).- Introducción a la Econometría. Un enfoque moderno. 2ª Edic. Thomson.

BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA

- Aznar, A.; García, A. y [Martín](#), A. (1994).- Ejercicios de Econometría I. Ed. Pirámide.
- Fernández, A.I. y otros (1995).- Ejercicios de Econometría. Ed. McGraw Hill.
- Fernández, P.; Salmerón R. y Blanco, V. (2016). Prácticas de Econometría con Excel, Getl y RStudio. Ed. Fleming.
- González, S.; (Coordinadora) (2007). Ejercicios resueltos de Econometría. El modelo de regresión múltiple. Delta Publicaciones.
- Hernández, J. (1989).- Ejercicios de Econometría. Ed. ESIC.
- Pena, J.B. y otros (1999).- Cien Ejercicios de Econometría. Ed. Pirámide.
- Pérez, T.; Amoros, P. y Relloso, S. (1993).- Ejercicios de Econometría Empresarial. Ed. McGraw Hill

ENLACES RECOMENDADOS

- Web del Dpto. de Métodos Cuantitativos para la Economía y la Empresa.
- Instituto nacional de Estadística.
- Instituto de estadística andaluz.
- Banco de España.
- Bolsa de Madrid.
- Anuario Económico de La Caixa.
- Eurostat.



- Proyecto GUIME

METODOLOGÍA DOCENTE

- MD01 Docencia presencial en el aula
- MD02 Estudio individualizado del alumno, búsqueda, consulta y tratamiento de información, resolución de problemas y casos prácticos, y realización de trabajos y exposiciones.
- MD03 Tutorías individuales y/o colectivas y evaluación

EVALUACIÓN (instrumentos de evaluación, criterios de evaluación y porcentaje sobre la calificación final)

EVALUACIÓN ORDINARIA

Con objeto de evaluar la adquisición de los contenidos y competencias a desarrollar en la materia, se utilizará un sistema de evaluación diversificado, seleccionando las técnicas de evaluación más adecuadas para la asignatura en cada momento, que permita poner de manifiesto los diferentes conocimientos y capacidades adquiridos por el alumnado al cursar la asignatura.

Se utilizarán alguna o algunas de las siguientes técnicas evaluativas:

- Prueba escrita: exámenes de ensayo, pruebas objetivas, resolución de problemas, casos o supuestos, pruebas de respuesta breve o test, informes o interpretación de resultados.
- Prueba oral: exposiciones de trabajos en clase, individuales o en grupo, sobre contenidos de la asignatura y sobre ejecución de tareas prácticas correspondientes a competencias concretas.
- Técnicas basadas en la asistencia y participación activa del alumno en clase, seminarios y tutorías.

El sistema de calificaciones se expresará mediante calificación numérica de acuerdo con lo establecido en el art. 5 del R. D 1125/2003, de 5 de septiembre, por el que se establece el sistema europeo de créditos y el sistema de calificaciones en las titulaciones universitarias de carácter oficial y validez en el territorio nacional. En ambos grupos se seguirá el mismo sistema de evaluación, sin que las fechas estipuladas para exámenes, pruebas, prácticas o trabajos, tengan necesariamente que coincidir. La calificación global de la convocatoria ordinaria corresponderá a la puntuación ponderada de los diferentes aspectos y actividades que integran el sistema de evaluación:

- Prueba escrita, con una ponderación del 70% de la calificación final, que constará de parte teórica y parte práctica.
- Evaluación continua, con una ponderación del 30% de la calificación final, que estará formada por pruebas de clase (teóricas, prácticas, de ordenador o interpretación de resultados obtenidos con el mismo); trabajos valorados positivamente, exposiciones,...etc.

Para superar la asignatura, tanto en la convocatoria ordinaria como en la extraordinaria será necesario que en la prueba escrita se obtenga una puntuación mínima de cinco puntos (en la



escala de cero a diez) siendo necesario al menos un 35% en cada una de las partes (teoría y práctica) para hacer la media. Además, la calificación global de la asignatura (una vez evaluadas las dos pruebas que la integran) ha de ser mayor o igual que 5 en una escala de cero a diez.

En caso de no cumplir los criterios anteriores, la calificación global de la asignatura en la convocatoria será SUSPENSO, con una calificación numérica que se obtendrá como el mínimo entre 4 puntos y la suma de las puntuaciones de las partes de teoría y práctica de la prueba escrita.

El estudiante que no se presente a la prueba escrita en la convocatoria ordinaria o extraordinaria tendrán la calificación de “No Presentado”.

EVALUACIÓN EXTRAORDINARIA

Con objeto de evaluar la adquisición de los contenidos y competencias a desarrollar en la materia, se utilizará un sistema de evaluación diversificado, seleccionando las técnicas de evaluación más adecuadas para la asignatura en cada momento, que permita poner de manifiesto los diferentes conocimientos y capacidades adquiridos por el alumnado al cursar la asignatura.

Se utilizarán alguna o algunas de las siguientes técnicas evaluativas:

- Prueba escrita: exámenes de ensayo, pruebas objetivas, resolución de problemas, casos o supuestos, pruebas de respuesta breve o test, informes o interpretación de resultados.
- Prueba oral: exposiciones de trabajos en clase, individuales o en grupo, sobre contenidos de la asignatura y sobre ejecución de tareas prácticas correspondientes a competencias concretas.
- Técnicas basadas en la asistencia y participación activa del alumno en clase, seminarios y tutorías.

El sistema de calificaciones se expresará mediante calificación numérica de acuerdo con lo establecido en el art. 5 del R. D 1125/2003, de 5 de septiembre, por el que se establece el sistema europeo de créditos y el sistema de calificaciones en las titulaciones universitarias de carácter oficial y validez en el territorio nacional. En ambos grupos se seguirá el mismo sistema de evaluación, sin que las fechas estipuladas para exámenes, pruebas, prácticas o trabajos, tengan necesariamente que coincidir. La calificación global de la convocatoria ordinaria corresponderá a la puntuación ponderada de los diferentes aspectos y actividades que integran el sistema de evaluación:

- Una prueba escrita con una ponderación del 70% de la calificación final, que constará de parte teórica, y parte práctica.
- Una prueba complementaria, con una ponderación del 30%, que consistirá en una prueba del contenido de la asignatura, utilizando ordenadores o interpretación de resultados obtenidos con el mismo, y que podría realizarse en el aula de informática. Esta prueba tendrá lugar una vez finalizada la prueba escrita, pudiendo realizarse en días posteriores si fuese necesario por problemas de espacio u horario.

EVALUACIÓN ÚNICA FINAL

El sistema de evaluación es preferentemente continuo. No obstante, el estudiante podrá solicitar la “Evaluación Única Final” de acuerdo con la normativa de la Universidad de Granada. La prueba para los estudiantes a los que les concedan acogerse a evaluación única final se realizará en la misma fecha que la prueba de evaluación escrita para los estudiantes de evaluación ordinaria.



La prueba de evaluación única final constará de:

- Prueba escrita con una ponderación del 70% de la calificación final, que constará de parte teórica, y parte práctica. Coincidirá con la prueba de los alumnos de evaluación continua.
- Una prueba complementaria, con una ponderación del 30%, que consistirá en una prueba del contenido de la asignatura, utilizando ordenador o interpretación de resultados obtenidos con el mismo, y que podría realizarse en el aula de informática. Esta prueba tendrá lugar una vez finalizada la prueba escrita, pudiendo realizarse en días posteriores si fuese necesario por problemas de espacio u horario.

Para superar la asignatura será necesario que en la prueba escrita de evaluación única final se obtenga una puntuación mínima de cinco puntos (en la escala de cero a diez) siendo necesario al menos un 35% en cada una de las partes (teoría y práctica) para hacer la media. Además, la calificación global de la asignatura (una vez evaluadas las dos pruebas que la integran) ha de ser mayor o igual que 5 en una escala de cero a diez.

El estudiante a quien habiéndole sido concedida la Evaluación Única Final no se presente a la prueba escrita de la evaluación única final tendrá la calificación de “No presentado”.

INFORMACIÓN ADICIONAL

- Es posible que a lo largo del curso se modifique algún horario de tutorías. Se aconseja consultar las tutorías actualizadas en el tablón de anuncios del Departamento.
- En la dirección de la secretaria general se puede consultar la Normativa de evaluación y de calificación de los estudiantes de la Universidad de Granada, las Instrucciones para la aplicación de la normativa de evaluación y de calificación de los estudiantes de la Universidad de Granada y la Instrucción relativa a la aplicación del artículo 8.2 de la Normativa de Evaluación y de Calificación de los Estudiantes de la Universidad de Granada

