



Universidad
de Alcalá

GUÍA DOCENTE

ECONOMETRÍA II

Grado en Economía
Grado en Economía y Negocios
Internacionales
Grado en Administración y Dirección
de Empresas (Plan de estudios G340)
Grado en Contabilidad y Finanzas
Universidad de Alcalá

Curso Académico 2019/2020
3^{er}. Curso – 2^o. Cuatrimestre

GUÍA DOCENTE

Nombre de la asignatura:	ECONOMETRÍA II
Código:	360020
Titulación en la que se imparte:	GRADO EN ECONOMÍA GRADO EN ECONOMÍA Y NEGOCIOS INTERNACIONALES GRADO EN ADMINISTRACIÓN Y DIRECCIÓN DE EMPRESAS (Plan de estudios G340) GRADO EN CONTABILIDAD Y FINANZAS
Departamento y Área de Conocimiento:	ECONOMIA ECONOMÍA APLICADA
Carácter:	OBLIGATORIA en Grado en Economía OPTATIVA en resto de Grados
Créditos ECTS:	6 ECTS
Curso y cuatrimestre:	3^{er}. CURSO, 2^{er}. CUATRIMESTRE
	JOSÉ MARÍA ARRANZ MUÑOZ (coordinador) ESTHER GALINDO FRUTOS M^a JOSÉ LECETA REY CRISTINA SUÁREZ GÁLVEZ M^a DEL MAR ZAMORA SANZ
	<p style="text-align: center;">Se podrán concertar tutorías, previa petición en clase o por e-mail, para los horarios que se establezcan al inicio del curso.</p>
Horario de Tutoría:	<p>]</p> <p>[josem.arranz@uah.es] [esther.galindo@uah.es] [mjose.leceta@uah.es] [cristina.suarez@uah.es] [mariam.zamora@uah.es]</p>
Idioma en el que se imparte:	Español/Inglés

1. INTRODUCCIÓN

La Econometría puede entenderse como la parte de la Economía que combina la Teoría Económica, la Estadística y las Matemáticas para comprender las relaciones cuantitativas de los comportamientos económicos. En este sentido es una disciplina que se ocupa del análisis empírico de las relaciones económicas ayudando a la validación o rechazo de las aportaciones de la Teoría Económica, ofreciendo instrumentos estadísticos apropiados para la contrastación de hipótesis teóricas y especificando modelos que posean buenas propiedades predictivas.

Para ello, la Econometría vincula teoría y datos con el propósito de cuantificar y explicar las relaciones económicas utilizando las herramientas que le proporciona la estadística y las matemáticas. Así pues, la modelización econométrica presenta cuatro objetivos simultáneos: simplificación de las relaciones económicas, interpretación de los datos, elección entre teorías alternativas y, finalmente, incremento y consolidación del conocimiento empírico acerca de cómo funciona la Economía.

Además, las materias de Econometría constituyen el último escalón en la formación estadístico económica obligatoria de un Graduado en Economía por lo que su estudio debe facilitar las herramientas necesarias para contrastar la validez empírica de las distintas teorías económico-empresariales. Con este propósito, la asignatura se diseña con un enfoque de carácter fundamentalmente práctico pero sin obviar los contenidos teóricos en que se sustenta. En este sentido, la asignatura Econometría II desarrolla, sobre la base de los modelos de regresión lineales, modelos más complejos ofreciendo al alumno, de un modo claro y a la vez preciso, avances en los fundamentos de la Econometría como herramienta para el análisis, estudio y desarrollo de modelos econométricos..

Con este propósito se pretende que los conocimientos adquiridos tras el estudio de esta asignatura sean útiles para entender y abordar con éxito la modelización y comprensión de los estudios econométricos que abordará en su futuro profesional y/o en asignaturas de cursos superiores de postgrado.

Muy brevemente se puede señalar que la asignatura Econometría II aborda, con un mayor nivel de profundidad que el estudiado en la asignatura Econometría I, el estudio de los modelos de regresión uniecuacionales tanto estáticos como dinámicos, así como el estudio de modelos con variables dependientes cualitativas y de ecuaciones simultáneas.

Prerrequisitos y Recomendaciones (si es pertinente)

Para que los estudiantes puedan seguir de forma adecuada esta asignatura es necesario que hayan alcanzado conocimientos básicos de Econometría. Para ello se recomienda haber cursado las asignaturas de Econometría I, Análisis Matemático, Optimización para el Análisis Económico, las asignaturas de Estadística Económica I y II y las asignaturas de Teoría Económica Microeconomía I y II y Macroeconomía I y II.

1. INTRODUCTION

Econometrics is understood as the part of Economics that combines Economic Theory, Statistics and Mathematics, in order to understand the quantitative relations in economic behaviour.

In this sense, it is a discipline that deals with the empirical analysis of economic relationships, helping to validate or reject the contribution of economic theory, offering appropriate statistical instruments for the comparison of theoretical hypothesis and finally, specifying models which pose good predictions.

To achieve this, econometrics entails theory and data with the purpose of quantifying and explaining the economic relationships, using tools provided by statistics and mathematics. In this way, econometric modelling proposes four simultaneous objectives: simplification of economic relationships, interpretation of data, choice of alternative theories and, finally, an increase and consolidation of empirical knowledge of how Economics functions.

Furthermore, the econometric materials constitute the final step in the compulsory economic statistical training of a graduate in Economics, for which reason, their studies should include the necessary tools to prove the empirical validity of the distinct theories of economics and business studies. With this purpose, the subject is designed with a fundamentally practical approach but without ignoring the theoretical contents, on which the subject is based. In this respect, Econometrics II develops more complex models on the basis of the models of linear regression. The subject offers to the student, in a clear and precise way, advances in the foundations of Economics as a tool for analysis, study and the development of econometric models.

With this purpose, it is intended that the knowledge gained after studying this subject will be useful to successfully understand and approach the modelling and understanding of econometric studies that the student will tackle in their professional career and/or in postgraduate courses.

Very briefly, it is possible to show that Econometrics II tackles, more in depth than in Econometrics I, the study of both static and dynamic single equation regression, as well as the study of models with qualitative dependant variables and simultaneous equation models.

Pre-requisites and Recommendations (if relevant)

In order that the students can properly follow this subject, it is necessary that they have basic knowledge of Econometrics. Therefore it is recommended that they have taken Econometrics I, Mathematical Analysis, Optimization of Economic Analysis, Statistical Economics I and II, Microeconomic Economic Theory I and II and Macroeconomic Economic Theory I and II.

2. COMPETENCIAS

Competencias genéricas:

1. Capacidad para la resolución de problemas
2. Capacidad de análisis y síntesis
3. Habilidad para analizar y buscar información proveniente de fuentes diversas
4. Capacidad de tomar decisiones
5. Capacidad para trabajar en equipo
6. Capacidad de adaptación a nuevas situaciones

Competencias específicas:

1. Cognitivas (Saber)
 - a. Conocimiento de los fundamentos teóricos e instrumentales básicos para el análisis econométrico
 - b. Adquisición y manejo de los términos específicos de la materia, teorías y aplicaciones básicas, conceptos elementales y adquisición de una visión global de su contenido.
2. Procedimentales/Instrumentales (Saber hacer)
 - a. Desarrollo de la capacidad de análisis de la realidad económico-empresarial.
 - b. Manejo y correcta aplicación de las técnicas instrumentales adecuadas para contrastar la validez empírica de distintas teorías económicas
 - c. Análisis de la información estadística disponible a través de un razonamiento riguroso y sistemático que permita extraer de los datos la máxima información relevante posible.
 - d. Capacidad para interrelacionar los conocimientos adquiridos en diversas materias de la titulación en el ámbito matemático, estadístico y de teoría económica.
 - e. Capacidad para aplicar lo conocimientos teóricos adquiridos a la práctica econométrica
 - f. Manejo del software informático adecuado (EViews).
 - g. Identificación de las fuentes de información económico-empresarial relevante.
 - h. Uso de las tecnologías de la información y la comunicación (TICs)
3. Actitudinales (Ser):
 - a. Razonamiento lógico y crítico
 - b. Capacidad de aprendizaje autónomo y habilidades de investigación
 - c. Capacidad de trabajo en equipo y cultura participativa

3. CONTENIDOS

Bloques de contenido (se pueden especificar los temas si se considera necesario)	Total de clases, créditos u horas
Modelos para variables dependientes cualitativas: Modelos logit y probit	• 21 horas
Variables instrumentales	• 9 horas
Modelos de ecuaciones simultáneas	• 18 horas

Cronograma (Optativo)

Semana / Sesión	Contenido
01 ^a -07 ^a	• Modelos para variables dependientes cualitativas: modelos logit y probit
08 ^a -09 ^a	• Método de variables instrumentales
10 ^a -14 ^a	• Modelos de ecuaciones simultáneas
15 ^a	• Repaso y examen

4. METODOLOGÍAS DE ENSEÑANZA-APRENDIZAJE.-ACTIVIDADES FORMATIVAS

4.1. Distribución de créditos (especificar en horas)

Número de horas presenciales: 48	Clases magistrales teóricas: 22,5 (1,5h*15 semanas) Clases prácticas y seminarios: 22,5 (1,5h*15 semanas) Exámenes y pruebas de evaluación: 3
Número de horas del trabajo propio del estudiante: 102	Horas de estudio autónomo: 50 Elaboración y resolución de ejercicios: 22 Elaboración de trabajos y actividades: 30
Total horas: 150	

4.2. Estrategias metodológicas, materiales y recursos didácticos

<p>Clases presenciales</p>	<p><u>Clases teóricas</u> en las que el profesor, a través de la clase magistral, desarrollará los conceptos básicos de cada uno de los temas contenidos en el programa. Asimismo, en estas clases se orientará el trabajo de estudio a realizar por los alumnos.</p> <p><u>Clases prácticas</u> en las que el profesor podrá desarrollar los conceptos auxiliares que considere convenientes si bien, su principal objetivo es que sirvan para la realización de casos prácticos de aplicación de los contenidos expuestos en las clases teóricas. Estas clases prácticas se desarrollarán, siempre que sea posible, en el Aula de Informática con el fin de profundizar en el manejo del programa <i>Econometric Views</i>.</p>
<p>Trabajo autónomo</p>	<p>El trabajo personal autónomo del alumno es uno de los elementos fundamentales del proceso de aprendizaje. Este trabajo autónomo deberá orientarse de modo que garantice el aprendizaje de la materia impartida en las clases presenciales teóricas y prácticas y en él se puede diferenciar un tiempo de estudio y un tiempo de trabajo aplicado.</p> <p><u>Estudio por parte del alumno.</u> Como parte del trabajo autónomo de alumno, éste deberá revisar y comprender los materiales bibliográficos y cualquier otro material que pueda proponerse en el desarrollo de la asignatura.</p> <p><u>Trabajo aplicado.</u> El alumno deberá dedicar parte de su tiempo de trabajo autónomo a la realización de actividades y ejercicios aplicados propuestos en clase.</p>
<p>Tutorías</p>	<p>Las tutorías serán opcionales para los alumnos y podrán ser en grupo o individuales.</p> <p>En las tutorías el profesor orientará y guiará a los estudiantes en la realización de las actividades académicas dirigidas con el fin de comprobar el modo en que éstas se van llevando a cabo y así poder</p>

resolver las dudas y cuestiones que puedan surgir. En las tutorías el profesor tratará de orientar el estudio personal del alumno que lo necesite, aclarando las dudas concretas que puedan surgir, corrigiendo los conceptos mal adquiridos y orientando al estudiante acerca de cómo superar provechosamente la asignatura y potenciar su afán de conocimiento. Las horas de tutoría o de consulta que cada profesor pondrá a disposición de los alumnos serán comunicadas a éstos a principios de curso y publicadas en el Aula Virtual de la asignatura.

5. EVALUACIÓN: Procedimientos, criterios de evaluación y de calificación

Criterios de evaluación

Los criterios de evaluación de esta materia orientados a la valoración de la adquisición de las competencias generales y específicas de la asignatura. Para ello, la evaluación de la asignatura contemplará la evaluación tanto de los contenidos teóricos como prácticos impartidos en las clases presenciales así como de los adquiridos a través del trabajo autónomo del estudiante.

Criterios de calificación

En una escala de notas numéricas con un decimal y una calificación cualitativa:

0,0 - 4,9	SUSPENSO
5,0 - 6,9	APROBADO
7,0 - 8,9	NOTABLE
9,0 - 10	SOBRESALIENTE
9,5 - 10	MATRÍCULA DE HONOR (limitada al 5% y convocatoria ordinaria)

Modo de evaluación

La evaluación de la asignatura **en la convocatoria ordinaria** se puede realizar, de acuerdo a la normativa de la UAH, con los procedimientos siguientes:

1. Sistema de evaluación continua
2. Evaluación final

1. Sistema de evaluación continua

La evaluación de la asignatura contemplará la evaluación tanto de los contenidos teóricos como prácticos adquiridos a través de las clases presenciales y del trabajo individual del estudiante. Esta evaluación contemplará la realización de dos pruebas o exámenes parciales de contenido teórico y aplicado, uno en la semana 7ª del curso y otra en la semana 14ª que evaluarán el contenido de la asignatura hasta esa semana. Aquellos alumnos que saquen más de un 5 en ambas pruebas no realizarán el examen final. Aquellos que no superen alguno de los dos exámenes parciales repetirán dicha prueba en el examen final. Para poder optar por el sistema de evaluación continua el alumno deberá acudir a clase al menos al 70-75% de las clases.

La evaluación de los contenidos teórico-prácticos a través de cada prueba o examen parcial se llevará a cabo mediante la realización de un examen escrito que podrá contener una parte teórica y otra parte práctica con ejercicios y cuestiones teórico-prácticas y prácticas basadas en los conocimientos adquiridos en las sesiones prácticas de la asignatura.

Otras actividades académicas dirigidas que ayudarán a completar la evaluación de los conocimientos adquiridos y que podrán plantearse a lo largo del curso serán pruebas sorpresa y entrega de ejercicios.

Como parte de la calificación para los alumnos que escojan el sistema de evaluación continua se tendrá en cuenta la actitud del alumno ante la asignatura, su participación en clase y la realización de toda aquella actividad que pueda ser propuesta por el profesorado durante el curso.

2. Evaluación final

El alumno que opte por la modalidad de Evaluación Final para superar esta asignatura deberá realizar, en las fechas y términos fijados por los organismos competentes, un examen final que constará de preguntas teóricas y prácticas.

Para aprobar la asignatura por este procedimiento el alumno deberá obtener como mínimo una calificación de 5 puntos en este examen.

La evaluación de la asignatura **en las convocatorias extraordinarias** obliga a la realización de una prueba de carácter final (examen final) que tendrá características similares a las especificadas para la convocatoria ordinaria y que se realizará en las fechas oficiales fijadas por los organismos competentes. Este examen final será el único elemento a tener en cuenta para determinar la calificación final del alumno en la convocatoria extraordinaria.

Aclaraciones

Para cualquier circunstancia no contemplada en esta guía docente se seguirá la "Normativa Reguladora de los Procesos de Evaluación de los Aprendizajes" aprobada en Consejo de Gobierno de 24 de marzo de 2011.

Para la realización de las distintas pruebas propuestas como parte de la evaluación de la asignatura únicamente se permitirá la utilización de calculadora y/o de cualquier otro material de apoyo que pueda resultar necesario cuando esté autorizado expresamente por el profesor de la asignatura.

El alumno deberá acudir necesariamente a todos los exámenes y pruebas de evaluación provisto de su DNI y de su Tarjeta Universitaria Inteligente (carne universitario).

6. BIBLIOGRAFÍA

Bibliografía Básica

- Greene, W., (1999), Análisis Econométrico. Ed. Prentice Hall, Madrid.
- Gujarati, D. y Porter, D.C. (2010), Econometría. 5ª Ed. McGraw-Hill, México.
- Wooldridge, J., (2016), Introducción a la Econometría. Ed. Thomson, 4ª Edición. Madrid.