

GUÍA DOCENTE ABREVIADA DE LA ASIGNATURA

G944 - Econometría Aplicada

Doble Grado en Administración y Dirección de Empresas y Economía
Grado en Economía

Curso Académico 2021-2022

| 1. DATOS IDENTIFICATIVOS | | | | | |
|--------------------------|--|------------------|-------------------|----------------------|--|
| Título/s | Doble Grado en Administración y Dirección de Empresas y Economía | | | Tipología v Curso | Obligatoria. Curso 5 Obligatoria. Curso 4 |
| Centro | Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales | | | | |
| Módulo / materia | MATERIA MÉTODOS ECONÓMICOS MÓDULO DE FORMACIÓN EN MÉTODOS CUANTITATIVOS | | | | |
| Código y denominación | G944 - Econometría Aplicada | | | | |
| Créditos ECTS | 6 | Cuatrimestre | Cuatrimestral (1) | | |
| Web | http://moodle.unican.es | | | | |
| Idioma de impartición | Español | English friendly | Sí | Forma de impartición | Presencial |

| | |
|----------------------|--|
| Departamento | DPTO. ECONOMIA |
| Profesor responsable | JOSE LUIS GALLEGO GOMEZ |
| E-mail | jose.gallego@unican.es |
| Número despacho | Edificio de las Facultades de Derecho y Ciencias Económicas y Empresariales. Planta: + 1. DESPACHO PDI (E158) |
| Otros profesores | NAMKEE AHN JUNG |

3.1 RESULTADOS DE APRENDIZAJE

- Comprender las propiedades estadísticas de los datos de series temporales y las de los datos de sección cruzada.
- Aprender el arte de la elaboración de modelos macro y micro-económicos.
- Saber cómo usar los modelos macro y micro-económicos en la toma de decisiones económicas.
- Adquirir destreza en el manejo software econométrico.

4. OBJETIVOS

Capacitar al alumno para comprender, elaborar y utilizar modelos macro y micro-económicos.

| 6. ORGANIZACIÓN DOCENTE | |
|-------------------------|--|
| CONTENIDOS | |
| 1 | Microeconometría. |
| 1.1 | Modelos de respuesta binaria. El modelo de probabilidad lineal. Modelos logit y probit: especificación, estimación, contraste de hipótesis, bondad de ajuste, predicción e interpretación. Aplicaciones. |
| 1.2 | Modelos de respuesta múltiple. Categorías ordinales. Modelos logit y probit ordenados: especificación, estimación, contraste de hipótesis, bondad de ajuste, predicción e interpretación; el supuesto de regresiones paralelas. Categorías nominales. Modelos logit multinomial y condicional: independencia de alternativas irrelevantes. |
| 2 | Macroeconometría. |
| 2.1 | Regresión con datos de series temporales. Modelos estacionarios y no estacionarios. Regresión espuria. Contrastes de raíces unitarias. Cointegración. El modelo de corrección de error. Aplicaciones. |
| 2.2 | Modelos autorregresivos vectoriales. Los modelo VAR y VEC: especificación, estimación, diagnóstico y usos. Contrastes de cointegración multivariante. El problema de identificación. |

| 7. MÉTODOS DE LA EVALUACIÓN | | | | |
|---|---------------------------|-------------|----------|--------|
| Descripción | Tipología | Eval. Final | Recuper. | % |
| Microeconometría | Evaluación en laboratorio | No | Sí | 50,00 |
| Macroeconometría | Evaluación en laboratorio | No | Sí | 50,00 |
| TOTAL | | | | 100,00 |
| Observaciones | | | | |
| <p>El examen de cada prueba de evaluación continua consistirá en el desarrollo una aplicación empírica con R/RStudio y en la resolución de preguntas teórico-prácticas sobre la misma. Cada prueba conjunta de evaluación continua se calificará de 0 a 10; se exige una nota mínima de 4 en cada prueba para calcular la media aritmética de las dos calificaciones. Cumpliéndose este requisito, se aprueba la asignatura con una calificación final igual o mayor que 5. Los alumnos que obtengan una calificación inferior a 4 en una prueba de evaluación continua tendrán que recuperarla presentándose al examen correspondiente de la convocatoria ordinaria.</p> <p>Los exámenes de las convocatorias ordinaria y extraordinaria serán similares a los de las pruebas de evaluación continua. En cada convocatoria habrá un examen de Microeconometría y otro de Macroeconometría.</p> <p>Los alumnos que deseen mejorar sus calificaciones de la evaluación continua podrán presentarse a la convocatoria ordinaria sin penalización, manteniéndose la calificación más alta.</p> <p>Los alumnos que no superen la asignatura en la convocatoria ordinaria se examinarán en la convocatoria extraordinaria del bloque en el que hayan tenido una calificación inferior a 4.</p> <p>En caso de que las autoridades sanitarias y educativas competentes indiquen que la evaluación sea no presencial, cada prueba de evaluación continua o de recuperación se dividirá en cuatro partes de 30 minutos que, tras consultar a la clase, se realizarán secuencialmente en uno o varios días.</p> | | | | |
| Criterios de evaluación para estudiantes a tiempo parcial | | | | |
| <p>Aunque es altamente recomendable asistir a las clases teóricas y prácticas, la asistencia no es obligatoria, por lo que los alumnos a tiempo parcial pueden presentarse, si lo desean, a los controles de evaluación continua (a uno solo o a los dos). Los exámenes de las convocatorias ordinaria y extraordinaria son idénticos a los de los alumnos a tiempo parcial, pudiendo obtener una calificación de 0 a 10.</p> | | | | |

8. BIBLIOGRAFÍA Y MATERIALES DIDÁCTICOS

BÁSICA

Stock, J.H., Watson, M.W. (2019) Introduction to Econometrics, 4th ed., Pearson Education.

Gallego, J.L. (2021) Apuntes de Econometría Aplicada. Departamento de Economía, Universidad de Cantabria (moodle.unican.es).

Esta es la Guía Docente abreviada de la asignatura. Tienes también publicada en la Web la información más detallada de la asignatura en la Guía Docente Completa.