

## 27429 - Econometría III

### Información del Plan Docente

**Año académico:** 2023/24

**Asignatura:** 27429 - Econometría III

**Centro académico:** 109 - Facultad de Economía y Empresa

**Titulación:** 417 - Graduado en Economía

**Créditos:** 6.0

**Curso:** 4

**Periodo de impartición:** Primer semestre

**Clase de asignatura:** Obligatoria

**Materia:**

### 1. Información básica de la asignatura

Objetivos:

1. Consolidar la formación adquirida en las asignaturas de Econometría anteriores.
2. Completar esta formación con nuevos instrumentos.
3. Proporcionar un marco conceptual para realizar un trabajo aplicado.

Estos planteamientos y objetivos están alineados con los siguientes Objetivos de Desarrollo Sostenible (ODS) de la Agenda 2030 de Naciones Unidas (<https://www.un.org/sustainabledevelopment/es/>), de tal manera que la adquisición de los resultados de aprendizaje de la asignatura proporciona capacitación y competencia para contribuir en cierta medida a su logro

Objetivo 4: Garantizar una educación inclusiva, equitativa y de calidad y promover oportunidades de aprendizaje durante toda la vida para todos.

Meta 4.1: Educación de calidad para todos los estudiantes que permita una movilidad socioeconómica ascendente para todos ellos.

Objetivo 8: Promover el crecimiento económico inclusivo y sostenible, el empleo y el trabajo decente para todos.

Meta 8.1: Impulsar el progreso, crear empleos decentes para todos y mejorar los estándares de vida.

### 2. Resultados de aprendizaje

**El estudiante, para superar esta asignatura, deberá demostrar los siguientes resultados...**

El objetivo fundamental de la asignatura es que, al finalizar el curso, el estudiante domine de forma solvente las técnicas econométricas que aparecen en los programas de las asignaturas Econometría I, Econometría II y Econometría III y además, tenga una perspectiva global sobre las etapas a seguir cuando se realiza un trabajo aplicado.

El estudiante, para superar la asignatura, deberá demostrar:

- Ser capaz de transformar hipótesis económicas en modelos econométricos y aplicar las cuatro etapas básicas del método econométrico.
- Saber recopilar datos de distintas fuentes y transformarlos para ser usados en el análisis econométrico. Aplicar las técnicas econométricas adecuadas que, con la ayuda de un programa econométrico como
- Gretl, le ayuden al alumno a resolver problemas de interés.
- Saber analizar las características de las variables objeto de estudio para especificar adecuadamente los modelos.
- Saber cómo contrastar distintas hipótesis económicas.
- Conocer los principios fundamentales para discriminar entre modelos econométricos.
- 

El curso trata de reforzar ciertas *Aptitudes* específicas en los alumnos. En concreto, se pretende despertar y potenciar las actitudes siguientes:

- La importancia del contraste empírico para evaluar la calidad de las explicaciones de la economía.
- La relevancia de la cuantificación de las relaciones económicas para poder predecir y llevar a cabo un análisis

estructural.

- Aplicación con rigor de las técnicas econométricas adecuadas a cada situación.
- Extremar la calidad de la presentación de los resultados, aportando toda la información relevante, organizando bien el trabajo y utilizando un texto claro y comprensible.

### 3. Programa de la asignatura

Tema 1. Validación y Selección de Modelos Econométricos.

- Repaso del cumplimiento de las hipótesis.
- Estimadores MCG.
- Criterios de selección.

Tema 2: Regresores estocásticos.

- Regresores Estocásticos
- Estimación Consistente en presencia de Regresores Estocásticos
- Contrastes de Exogeneidad

Tema 3. Modelos dinámicos.

- Modelos Dinámicos, Especificación y Estimación
- Interpretación de los parámetros de un modelo ARDL(p,s)
- Modelos con Expectativas

Tema 4. Modelos de Ecuaciones Simultáneas.

- Forma Estructural, Reducida y Final de un MES
- Identificación de un MES
- Métodos de Estimación de un MES

Tema 5. Modelos VAR.

- Especificación y Estimación de un modelo VAR
- Contrastes de Especificación
- Función de Respuesta Impulso
- Descomposición de la Varianza

Tema 6. Modelos con variables no Estacionarias.

- Orden de Integración. Contrastes
- Cointegración en modelos uniecuacionales
- Contraste de Cointegración de Johansen

### 4. Actividades académicas

El programa docente de la asignatura Econometría III comprende:

**Clases teóricas:** Se emplearán para presentar los conceptos fundamentales de la asignatura, convenientemente estructurada en temas 28 horas

**Clases teórico-prácticas:** El profesorado prepara y resuelve una colección de problemas y de cuestiones teórico-prácticas relativas al contenido de la asignatura. 10 horas

**Clases prácticas de informática:** Esta actividad se desarrollará en las aulas de informática. El objetivo es ayudar a la comprensión de los contenidos teóricos y enseñar al alumno a poner los conocimientos en práctica. 18horas

**Tutorías:** Atención individualizada al alumnado dirigida a la resolución de dudas.

**Estudio Personal:** 90 horas

**Pruebas de Evaluación:** 4 horas

En principio la metodología de impartición de la docencia y su evaluación está previsto que pivote alrededor de clases presenciales. No obstante, si las circunstancias lo requieren, podrán realizarse de forma online.

## 5. Sistema de evaluación

En la PRIMERA CONVOCATORIA de la asignatura la evaluación tendrá dos opciones: a través de evaluación continua o bien a través del examen global de la asignatura.

En la opción de evaluación continua, se deberán realizar dos pruebas, de carácter teórico, teórico-práctico y de ordenador. La primera prueba ponderará al 50% de la nota final. La primera prueba se realizará al finalizar el tema 3 y comprenderá los temas 1 al 3; mientras que la segunda prueba será al final del cuatrimestre de los temas restantes y ponderará con un 50% y constará, igualmente, de una parte teórica, otra teórico-práctica, y una parte de ordenador.

La segunda opción consistirá en un examen global en el que se preguntarán cuestiones teóricas y/o teórico-prácticas de los contenidos del programa y una parte con ordenador. Los alumnos que hayan obtenido una nota igual o superior a 5 en alguna de las dos primeras pruebas de la evaluación continua pero no hayan superado esta evaluación, podrán liberar esa parte de la materia en el examen global de la primera convocatoria. Cualquier alumno que haya aprobado la evaluación continua puede optar a realizar el examen global para mejorar la nota.

La SEGUNDA CONVOCATORIA se evaluará a través de un examen único para todos los alumnos, con el mismo tipo de preguntas que el examen global de la primera convocatoria.

Todas las pruebas serán puntuadas en una escala de 0 a 10. Se aprueba la asignatura si la nota media ponderada o la nota del examen global es igual o mayor a 5.

Está previsto que estas pruebas se realicen de manera presencial pero si las circunstancias sanitarias lo requieren, se realizarán de manera semipresencial u online. En el caso de evaluación online, es importante destacar que, en cualquier prueba, el estudiante podrá ser grabado, pudiendo este ejercer sus derechos por el procedimiento indicado en:

[https://protecciondatos.unizar.es/sites/protecciondatos.unizar.es/files/users/lopd/gdocencia\\_reducida.pdf](https://protecciondatos.unizar.es/sites/protecciondatos.unizar.es/files/users/lopd/gdocencia_reducida.pdf)