

27443 - Aplicaciones econométricas

Información del Plan Docente

Año académico: 2023/24

Asignatura: 27443 - Aplicaciones econométricas

Centro académico: 109 - Facultad de Economía y Empresa

Titulación: 417 - Graduado en Economía

Créditos: 3.0

Curso: 4

Periodo de impartición: Primer semestre

Clase de asignatura: Optativa

Materia:

1. Información básica de la asignatura

El objetivo fundamental de la asignatura es tratar desde una perspectiva aplicada una serie de problemas que surgen en la práctica econométrica, como algunas cuestiones relacionadas con la especificación, estimación e interpretación de los modelos: los modelos con variable dependiente discreta, los modelos con datos de series temporales y los modelos con datos de panel. Los conocimientos anteriores y otras cuestiones nuevas serán fijados con la elaboración de unos casos prácticos que se resolverán con la ayuda del ordenador y que luego tendrán que exponerse públicamente.

Estos planteamientos y objetivos están alineados con los Objetivos de Desarrollo Sostenible (ODS) de la Agenda 2030 de Naciones Unidas (<https://www.un.org/sustainabledevelopment/es/>), en concreto, las actividades previstas en la asignatura contribuirán al logro de las metas 4.3, 4.4 y 4.5 del Objetivo 4 y al Objetivo 8.

2. Resultados de aprendizaje

- Conocer las técnicas básicas del análisis econométrico y adecuarlas al ámbito de aplicación de la economía.
- 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 en el ámbito económico.
- Saber cómo contrastar distintas hipótesis económicas a través de restricciones en los parámetros de los modelos.
- Saber cómo introducir variables ficticias en los modelos econométricos e interpretar su estimación.
- Identificar los problemas habituales que se pueden presentar en el término del error de un modelo econométrico (autocorrelación, heteroscedasticidad y normalidad) y saber cómo corregirlos.
- Estimar e interpretar modelos en los que la variable dependiente es de tipo discreto.
- Estimar e interpretar modelos de series temporales de alta frecuencia, determinando los distintos efectos de tipo ARCH que pueden encontrarse.
- Saber redactar un trabajo aplicado de econometría de forma rigurosa y comprensible.
- Resumir y agrupar las principales ideas de un trabajo y plasmarlas en una presentación de tipo PowerPoint.
- Defender públicamente la resolución de los casos que se irán planteando durante el curso.

3. Programa de la asignatura

PARTE I. Problemas habituales en la estimación econométrica. Modelos con variable dependiente binaria.

Temas de econometría que se tratarán en los casos prácticos:

- Estimación de modelos con problemas en la parte aleatoria, heteroscedasticidad y autocorrelación. Caso 1.1.
- Estimación de modelos con variable dependiente discreta. Caso 1.2.
- Estimación, validación e interpretación de resultados en todos los casos.

PARTE II. Modelos econométricos con datos de alta frecuencia y datos de panel.

Temas de econometría que se tratarán en los casos prácticos:

- Estimación de modelos con heteroscedasticidad condicional autorregresiva (ARCH). Caso 2.1.
- Estimación, validación e interpretación de resultados en todos los casos.

4. Actividades académicas

Clase magistral participativa: sesiones con el profesor en las que se explicará el temario de la asignatura, 11 horas

Problemas y casos: sesiones de resolución de casos prácticos planteados por el profesor, 8 horas

Trabajos docentes evaluables: tiempo dedicado por los alumnos a resolver casos evaluables, una parte en clase con apoyo

del profesor y otra parte de forma individual, 22 horas

Estudio personal: 25 horas

Pruebas de evaluación: se incluyen las presentaciones en clase y las pruebas escritas, 9 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

Primera convocatoria: se ofrecen al alumno dos sistemas de evaluación:

Opción 1: Evaluación continua.

- Presentación por escrito y oralmente de los casos propuestos por el profesor.
- El 90% de la nota de la evaluación continua se obtiene ponderando al 60% el trabajo escrito que presentan los alumnos, al 40% la presentación oral del mismo que se hace en clase. En la valoración de esta parte se tendrá en cuenta la resolución correcta de las preguntas, la justificación teórica, la correcta redacción económica y econométrica y la presentación pública.
- El 10% de la nota de la evaluación continua se obtendrá si los alumnos presentan individualmente por escrito una propuesta de estudio empírico concreto. En esta parte se valorará la originalidad de la propuesta y la viabilidad de llevar a cabo el trabajo con técnicas econométricas.

Opción 2: Examen global.

Preguntas teóricas y teórico-prácticas sobre los contenidos del curso y un examen de ordenador.

La parte teórica puntuará 5 puntos y la parte práctica de ordenador 5 puntos. Se aprueba la asignatura obteniendo al menos 5 puntos, con 3 puntos de nota mínima en cada parte.

Segunda convocatoria: examen global como el descrito anteriormente.