

30628 - Aplicaciones econométricas de la empresa

Información del Plan Docente

Año académico: 2023/24

Asignatura: 30628 - Aplicaciones econométricas de la empresa

Centro académico: 109 - Facultad de Economía y Empresa

Titulación: 432 - Programa conjunto en Derecho-Administración y Dirección de Empresas

Créditos: 5.0

Curso: 6

Periodo de impartición: Primer semestre

Clase de asignatura: Optativa

Materia:

1. Información básica de la asignatura

El objetivo fundamental de la asignatura es que, al finalizar el curso, el estudiante haya afianzado sus conocimientos sobre diversas técnicas econométricas que se aplican tanto en la resolución de problemas de la Teoría Económica como otros que pueden tener aplicación en problemas de la empresa. Para ello, se le darán al estudiante unos conocimientos que consolidarán los que ya adquirió en la asignatura Econometría, tanto en relación con los problemas que pueden aparecer tras la estimación, como otros temas nuevos, como el tratamiento de las series temporales univariantes y la regresión con series de tiempo que tienen en cuenta las posibles relaciones de cointegración entre las variables. Los conocimientos serán fijados con la resolución de casos prácticos que los alumnos resolverán con la ayuda del ordenador y que luego expondrán.

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 empresa.
- 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 empresarial.
- Distinguir los datos de series temporales de los de tipo transversal y qué problemas pueden aparecer con cada uno de ellos.
- 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.
- Saber cómo trabajar con series temporales de tipo univariante, conociendo las etapas básicas del análisis de Box-Jenkins.
- Saber usar el correlograma muestral de una serie temporal para identificar el proceso estocástico subyacente.
- Conocer los distintos tipos de tendencias temporales, identificando adecuadamente las tendencias temporales de las tendencias estocásticas.
- Saber tratar las series con tendencias estocásticas y determinar si presentan alguna relación de cointegración.
- 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. Los problemas de la empresa. Casos prácticos de estudio.

Temas de econometría que se tratarán en los casos prácticos:

- Contraste de hipótesis individuales y conjuntas.
- Selección de modelos anidados.
- Detección y tratamiento de problemas en el término de error.
- Variables ficticias.
- Estimación, validación e interpretación de resultados en todos los casos.

PARTE II. El entorno microeconómico de la empresa. Casos prácticos de estudio.

Temas de econometría que se tratarán en los casos prácticos:

- Estimación de formas funcionales.
- Contraste de hipótesis económicas mediante el uso de variables ficticias.
- Estimación con variable dependiente binaria.
- Estimación, validación e interpretación de resultados en todos los casos.

PARTE III. El entorno macroeconómico de la empresa. Casos prácticos de estudio.

Temas de econometría que se tratarán en los casos prácticos:

- Identificación y estimación de modelos ARIMA.
- Identificación del orden de integración de series temporales.
- Estimación de relaciones de cointegración.
- Estimación de los efectos a corto y largo plazo. Mecanismo de corrección del error.

4. Actividades académicas

Clase magistral participativa: sesiones con el profesor en las que se explicará el temario de la asignatura, 22 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, 40 horas

Estudio personal: 45 horas

Pruebas de evaluación: se incluyen las presentaciones en clase y las pruebas escritas, 10 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 2 puntos de nota mínima en cada parte.

Segunda convocatoria: examen global como el descrito anteriormente.