



Guía Docente				
Datos Identificativos				2021/22
Asignatura (*)	Técnicas Econométricas		Código	611532003
Titulación	Máster Universitario en Economía			
Descriptores				
Ciclo	Período	Curso	Tipo	Créditos
Mestrado Oficial	1º cuatrimestre	Primeiro	Obrigatoria	6
Idioma	Castelán/Galego			
Modalidade docente	Presencial			
Prerrequisitos				
Departamento	Economía			
Coordinación	Mourelle Espasandin, Estefanía	Correo electrónico	estefania.mourelle@udc.es	
Profesorado	Mourelle Espasandin, Estefanía	Correo electrónico	estefania.mourelle@udc.es	
Web	<a href="http://www.gcd.udc.es/emourelle">www.gcd.udc.es/emourelle</a>			
Descripción xeral	<p>Esta materia ten como principal fin que o estudiante adquira as competencias necesarias para detectar cando e como aplicar as técnicas econométricas necesarias para o estudio de situacions e casos con datos reais no eido da economía. O obxectivo reside, por tanto, en que o estudiante sexa capaz de extraer a información relevante das variables económicas e as súas interrelacións a través de diferentes tipos de análises e ferramentas, o cal lle permitirá comprender patróns de comportamento e efectuar as pertinentes valoracións. Asimismo, preténdese que o estudiante sexa crítico na avaliación do contexto económico e dos traballos que neste contexto deba avaliar.</p>			



Plan de continxencia	<p>*** PLAN DE CONTINXENCIA NO CASO DUN ESCENARIO DE NON PRESENCIALIDADE (BLOQUE IMPARTIDO NA UDC) ***</p> <p><b>1. MODIFICACIÓN NOS CONTIDOS</b></p> <p>En principio non se prevé a realización de cambios.</p> <p><b>2. METODOLOXÍAS</b></p> <p>*Metodoloxías docentes que se manteñen</p> <p>Prácticas a través de TIC</p> <p>Sesión maxistral</p> <p>Obradoiro</p> <p>Análise de fontes documentais (computa na avaliación)</p> <p>Aprendizaxe colaborativa: consta de dúas partes, o envío do traballo grupal e a exposición oral. O primeiro realizarase a través da pertinente plataforma virtual (computa na avaliación).</p> <p>*Metodoloxías docentes que se modifican</p> <p>Aprendizaxe colaborativa: consta de dúas partes, o envío do traballo grupal e a exposición oral. A segunda realizarase a través da pertinente plataforma virtual (computa na avaliación).</p> <p>Proba obxectiva (realizarase a través da pertinente plataforma virtual; computa na avaliación)</p> <p><b>3. MECANISMOS DE ATENCIÓN PERSONALIZADA AO ALUMNADO</b></p> <ul style="list-style-type: none"><li>- Correo electrónico. Temporalidade: diaria. Descripción: atención ao alumnado sobre diversas cuestiós relativas á materia.</li><li>- Campus Virtual (UDC)/MooVi (UVigo). Temporalidade: a petición do estudiante. Descripción: uso de foros, chats e outras canles de comunicación co alumnado sobre cuestiós de diversa índole en relación coa materia (dúbihadas puntuais, aclaracións, titorías, outras comunicacóns, etc.).</li><li>- MS Teams. Temporalidade: a petición do estudiante. Descripción: uso das ferramentas de comunicación co alumnado sobre cuestiós de diversa índole en relación coa materia (dúbihadas puntuais, aclaracións, titorías, outras comunicacóns, etc.).</li></ul> <p>Seguindo as recomendacións efectuadas desde o Decanato da Facultade de Economía e Empresa da UDC, as titorías individuais/grupais realizaranse preferentemente de xeito virtual/non presencial.</p> <p><b>4. MODIFICACIÓN NA AVALIACIÓN</b></p>
----------------------	--



\*Observacións de avaliación: non se verá afectada, salvo que as diferentes actividades contempladas serán levadas a cabo por vía telemática (no envío do traballo en grupo e a análise de fontes documentais emprégase, por defecto, esta modalidade).

## 5. MODIFICACIÓNS DA BIBLIOGRAFÍA OU WEBGRAFÍA

Na medida en que sexa posible, facilitarase o acceso en aberto á bibliografía sinalada nesta guía docente. En caso negativo, proporcionaranse documentos dixitalizados que sirvan de apoio ao estudiante (se ben na plataforma virtual empregada contarán con todos os apuntamentos e recursos adicionais necesarios para un normal desenvolvemento da materia).



## Competencias do título

Código	Competencias do título
A1	CE1 - Conocimiento de las herramientas matemáticas, estadísticas y econométricas necesarias para manejar con rigor los modelos económicos
A3	CE3 - Manejo de las técnicas económicas actuales.
A4	CE4 - Capacidad para modelar situaciones económicas concretas y obtener resultados con datos numéricos aplicando las técnicas económicas pertinentes.
A8	CE8 - Analizar y proponer cambios en el diseño de las organizaciones y de los sistemas de incentivos que mejoren el funcionamiento de los mismos en tener de su eficiencia.
A10	CE10 - Participar en grupos de trabajo interdisciplinarios ligados al estudio de las tendencias socio- económicas de largo plazo.
A12	CE12 - Analizar las ventajas y los inconvenientes de la regulación y de las políticas económicas y proponer alternativas.
B2	CB7 - Que los estudiantes sepan aplicar los conocimientos adquiridos y su capacidad de resolución de problemas en entornos nuevos o poco conocidos dentro de contextos más amplios (o multidisciplinares) relacionados con su área de estudio.
B5	CB10 - Que los estudiantes posean las habilidades de aprendizaje que les permitan continuar estudiando de un modo que habrá de ser en gran medida autodirigido o autónomo.
B7	CG2 - Capacidad de concebir, diseñar y poner en práctica un proceso sustancial de investigación en el campo de la economía en general, y en particular en sus áreas de especialización, con rigor académico.
B12	CG7 - Capacidad para presentar y defender con rigor, claridad y precisión nuevas ideas tanto en el entorno habitual de trabajo como en reuniones científicas nacionales o internacionales.
C4	CT4 - Capacidad para interaccionar y defender con rigor, claridad y precisión ante otro especialistas trabajos, propuestas, nuevas ideas etc.
C5	CT5 - Comunicación oral e escrita.
C9	CT9 - Destrezas para investigar.
C10	CT10 - Capacidad de análisis y síntesis.

## Resultados da aprendizaxe

## Resultados de aprendizaxe

## Competencias do título



SABER:  Comprender as ferramentas matemáticas básicas, necesarias para a formalización do comportamento económico. Adquirir habilidades na procura, identificación e interpretación de fontes de información económica relevante e do seu contido. Ser capaz de formular modelos simples de relación das variables económicas, baseados na utilización de instrumentos técnicos. Evaluar, utilizando técnicas empíricas, as consecuencias de distintas alternativas de acción e seleccionar as más idóneas.	AM1 AM3 AM4 AM8 AM10 AM12	BM2 BM5 BM7 BM12 CM4 CM5 CM9 CM10
SABER FACER:  Fomentar a actitude crítica e autocrítica. Ter capacidade para xerar reflexións propias sobre problemas de natureza económica e os seus efectos sociais e éticos. Autocontrol no sistema de traballo, con respecto a tempo e planificación. Fomentar o espíritu investigador, desenvolvendo a capacidade para analizar problemas novos cos instrumentos adquiridos. Adquirir competencias ligadas á procura de organización de documentación e á presentación do traballo de forma axeitada á audiencia. Ler e comunicarse en inglés no eido profesional. Capacidade de elaborar informes de asesoramento económico. Respeto aos valores éticos e cívicos. Compromiso ético co traballo. Capacidade para traballar en equipo. Responsabilidade e capacidade de asumir compromisos. Habilidades para argumentar de forma coherente e intelixible, tanto de forma oral como escrita.		

Contidos	
Temas	Subtemas
Tema 1.- Modelos lineais e non lineais	1.1. Linealidade e non linealidade. 1.2. Transformación das variables. 1.3. Modelos con variables de interacción. 1.4. Regresión non lineal.
Tema 2.- Problemas de especificación e problemas de datos	2.1. Especificación do modelo. 2.2. O problema dos datos. 2.3. Efectos da omisión e inclusión de variables. 2.4. Contrastes de especificación.
Tema 3.- O efecto do tempo nos modelos econométricos	3.1. Procesos estocásticos. 3.2. Funcións de autocorrelación. 3.3. Modelización lineal univariante. 3.4. Estacionariedade. Contrastes de raíces unitarias. 3.5. Cointegración. 3.6. Regresións espurias. 3.7. Introdución a modelos VAR. 3.8. Aplicacións empíricas con software econométrico.
Tema 4.- Modelos heterocedásticos: avaliando o risco	4.1. Introdución a modelos ARCH e GARCH. 4.2. Aplicacións empíricas con software econométrico.
Tema 5.- Regresores estocásticos: métodos de estimación dos momentos e variables instrumentais	5.1. Modelos con regresores estocásticos. 5.2. Variables instrumentais. 5.3. Método xeralizado de momentos.
Tema 6.- Manexo de distintos paquetes económétricos (aplicable a temas 1, 2 e 5).	Manexo de distintos paquetes económétricos.



Planificación				
Metodoloxías / probas	Competencias	Horas presenciais	Horas non presenciais / traballo autónomo	Horas totais
Prácticas a través de TIC	A4 A1 A3 B2 B5 B7 B12 C9	12	25	37
Sesión maxistral	A4 A1 A3 A8 A12 B2 B5 B7 C5 C9 C10	12	20	32
Traballos tutelados	A4 A1 A3 A8 A12 B2 B5 B7 B12 C4 C5 C9 C10	0	30	30
Aprendizaxe colaborativa	A4 A1 A3 A8 A10 A12 B2 B5 B7 B12 C4 C5 C9 C10	0	25	25
Obradoiro	A4 A1 A3 A8 B7 B2 C4 C5	5	1	6
Análise de fontes documentais	A4 A1 A3 B2 B5 C5 C9 C10	0	4	4
Proba obxectiva	A4 A1 A3 A8 A12 B2 B5 B7 B12 C4 C5 C10	2	13	15
Atención personalizada		1	0	1

\*Os datos que aparecen na táboa de planificación son de carácter orientativo, considerando a heteroxeneidade do alumnado

Metodoloxías		Descripción
Prácticas a través de TIC		Os estudiantes deben realizar, co apoio e a dirección do docente, as aplicacións empíricas que se lles propoñan.
Sesión maxistral		Exposición oral, apoiada en medios audiovisuais, que inclúe conceptos teóricos e exemplos prácticos.
Traballos tutelados		Os estudiantes deben levar a cabo, baixo tutela, traballos e/ou exercicios con datos reais aplicando as técnicas que se lles ensinaron no curso.
Aprendizaxe colaborativa		Traballo conxunto do alumnado, organizado en grupos, na resolución de tarefas asignadas polo profesor para optimizar tanto a súa propia aprendizaxe como a dos restantes membros do grupo.
Obradoiro		Nestas clases o obxectivo principal é a realización de tarefas eminentemente prácticas, co apoio e supervisión do docente: proposición e resolución de aplicacións da teoría, problemas, exercicios, exposicións, debates e comentarios de traballos, etc. Pódense expor as dúbdidas ou dificultades coas que se atopen os estudiantes en relación ás distintas actividades de avaliación (individuais ou en grupo). Desta forma se crea un debate entre os estudiantes, os seus compañeiros e o docente, o cal fomenta a interrelación no traballo e o espíritu crítico. Con todo, tamén o profesor pode expor conceptos, exposición enfocada principalmente a deixar clara a súa aplicación, ou, en todo caso, como simple comentario da sesión maxistral.
Análise de fontes documentais		Con esta análise preténdese que o estudiante conecte o aprendido na clase sobre unha determinada técnica econométrica e a súa aplicación empírica materializada en documentos de investigación; noutras palabras, o obxectivo é que o estudiante comprenda a utilidade real da técnica aprendida a través da procura de documentos de traballo e artigos científicos que fixeron uso dela con datos reais. Asimesmo, esta actividade permite comprobar tanto a capacidade de análise como a de síntese do estudiante.
Proba obxectiva		Proba para avaliar a capacidade que o estudiante ten para asimilar os conceptos e interrelacionalos. Tamén mide a súa capacidade para identificar problemas e avaliar a súa resolución.

Atención personalizada	
Metodoloxías	Descripción



Prácticas a través de TIC	* Prácticas a través de TIC
Traballos tutelados Obradoiro	Para a realización destas actividades os estudiantes precisan o asesoramento e, no seu caso, a dirección do docente.  * Traballos tutelados  Os estudiantes deben levar a cabo, baixo tutela, traballos e/ou exercicios con datos reais aplicando as técnicas que se lles ensinaron no curso.  * Obradoiro  Nestas clases pódense expor as dúbdidas ou dificultades coas que se atopen os estudiantes en relación ás distintas actividades de avaliación (individuais ou en grupo).

Avaliación				
Metodoloxías	Competencias	Descripción	Cualificación	
Análise de fontes documentais	A4 A1 A3 B2 B5 C5 C9 C10	Exercicio individual	15	
Proba obxectiva	A4 A1 A3 A8 A12 B2 B5 B7 B12 C4 C5 C10	Exame escrito	40	
Aprendizaxe colaborativa	A4 A1 A3 A8 A10 A12 B2 B5 B7 B12 C4 C5 C9 C10	Traballo en grupo	45	

#### Observacións avaliación

No curso académico 2021/2022, a materia dividirase en dúas partes interconectadas. A primeira delas será impartida por docentes da Universidade de Santiago de Compostela (USC) e terá lugar tamén en primeiro lugar no tempo. Con información de xullo de 2021, esta primeira parte correspondería aos temas 1, 2 e 5. A segunda parte (temas 3 e 4) sería impartida pola docente da Universidade da Coruña (UDC).

A avaliación da materia respectará a porcentaxe do 60% outorgada a actividades de avaliación continua e o 40% para a proba obxectiva ou exame. Os docentes de cada unha das partes levarán a cabo as súas proprias actividades de avaliación, tanto continua como proba obxectiva. Así, os docentes da USC desenvolverán as actividades de avaliación continua que estimen pertinentes en relación á parte da materia que imparten, e a correspondente proba obxectiva; as primeiras actividades ponderarán un 60%, mentres que a segunda, un 40%. De xeito similar, a docente da UDC levará a cabo actividades de avaliación continua de dous tipos (ver cadro) en relación aos temas que imparte, e unha proba obxectiva relativa únicamente a esta parte.

A cualificación final do estudiante será o resultado de ponderar as cualificacións obtidas en cada unha das partes (50% cada unha delas).

No caso da segunda oportunidade de avaliación, e coa fin de garantir a posibilidade de superación da materia consonte ás "Normas de avaliación, revisión e reclamación das calificacións dos estudios de grao e mestrado universitario" establecidas pola UDC, o estudiante poderá repetir tanto a actividade de proba obxectiva ou exame (ponderación, 40%) como o traballo tutelado (ponderación, 15%) referidos ao segundo bloque da materia. Para a primeira actividade existe unha data oficial de exame, e para a segunda se establecerá un procedemento de realización e entrega antes do comezo deste período de avaliación.

Importante: as actividades de avaliación continua específicas que figuran no cadro (exercicios e traballo) son exclusivas da parte que imparte a docente da UDC.

#### Fontes de información



Bibliografía básica	- Espasa, A.; Cancelo, J. R. (eds., 1993). Métodos cuantitativos para el análisis de la coyuntura económica. Alianza Editorial: Madrid.- Franses, P. H. (2014). Time series models for business and economic forecasting, 2nd edition. Cambridge University Press: Cambridge.- Hansen, B. E. (2021). Introduction to Econometrics. Department of Economics: University of Wisconsin.- Harvey, A. C. (1990). The Econometric Analysis of Time Series, 2nd edition. MIT Press: Cambridge. - Maddala, G. S. (1977). Econometrics. Mc Graw-Hill: Nova York. - Ullah, A.; Giles, D. E. A. (eds., 1998). Handbook of Applied Economic Statistics. Marcel Dekker: Nova York.Nota. Na medida en que sexa posible, facilitarase e comunicarase ao estudiantado a dispoñibilidade destas e outras fontes de información en formato dixital.
Bibliografía complementaria	- Hansen, B. E. (2021). Econometrics. Department of Economics: University of Wisconsin. (Ligazón: <a href="https://www.ssc.wisc.edu/~bhansen/econometrics/Econometrics.pdf">https://www.ssc.wisc.edu/~bhansen/econometrics/Econometrics.pdf</a> )- Wooldridge, J. M. (2010). Introducción a la econometría. Un enfoque moderno, 4a. edición. Cengage Learning Editores: México D. F.

Recomendacións	
Materias que se recomenda ter cursado previamente	
Métodos Cuantitativos/611532004	
	Materias que se recomenda cursar simultaneamente
Microeconomía Avanzada/611532028	
Macroeconomía avanzada/611532029	
	Materias que continúan o temario
Econometría Avanzada/611532027	
Observacións	
Para	
cursar a materia é aconsellable posuir coñecementos de Econometría (cando menos a un nivel	
introductorio). En todo caso, homoxeneizaranse na medida do posible os niveis de inicio de existir disparidade no estudiantado.&nbsp;	Asimesmo,
recoméndase posuir coñecementos de inglés, especialmente na comprensión lectora, xa que unha parte importante do material que se facilitará	
ao estudiante está nesta lingua.Igualmente, e de cara a colaborar no desenvolvemento dunha Facultade más sustentable, se sinala o seguinte: 1. A	
entrega dos traballos documentais de avaliación continua que se realicen nesta materia solicitarase en formato virtual e/ou soporte informático, sen	
necesidade de impresión.&nbsp;	2. Débese ter en conta a importancia dos principios éticos relacionados cos
valores da sustentabilidade e nos	
comportamentos persoais e profesionais.	

(\*)A Guía docente é o documento onde se visualiza a proposta académica da UDC. Este documento é público e non se pode modificar, salvo casos excepcionais baixo a revisión do órgano competente dacordo coa normativa vixente que establece o proceso de elaboración de guías