UNIVERSIDADE DA CORUÑA

Guía Docente					
Datos Identificativos					2019/20
Asignatura (*)	Técnicas Econométricas			Código	611532003
Titulación	Máster Universitario en Economía				
Descriptores					
Ciclo	Período	Curso		Tipo	Créditos
Mestrado Oficial	1º cuadrimestre	Primeiro		Obrigatoria	6
Idioma	CasteláNGalego				
Modalidade docente	Presencial				
Prerrequisitos					
Departamento	EconomíaEconomía Aplicada 2				
Coordinación	Mourelle Espasandin, Estefania		Correo electrónico	estefania.mourelle@udc.es	
Profesorado	Mourelle Espasandin, Estefania		Correo electrónico	estefania.mourelle@udc.es	
Web	www.gcd.udc.es/emourelle				
Descrición xeral	Esta materia tiene como principal finalidad que el estudiante adquiera las competencias necesarias para detectar cuándo y cómo aplicar las técnicas econométricas necesarias para el estudio de situaciones y casos con datos reales en el ámbito de la economía. El objetivo reside, por tanto, en que el estudiante sea capaz de extraer la información relevante de las variables económicas y sus interrelaciones a través de diferentes tipos de análisis y herramientas, lo cual le permitirá comprender patrones de comportamiento y efectuar las pertinentes valoraciones. Asimismo, se pretende que el estudiante sea crítico en la evaluación del contexto económico y de los trabajos que en este contexto deba evaluar.				

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 econométricas actuales.
A4	CE4 - Capacidad para modelar situaciones económicas concretas y obtener resultados con datos numéricos aplicando las técnicas econométricas 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:	AM1	BM2	CM4
Comprender as ferramentas matemáticas básicas, necesarias para a formalización do comportamento económico.	AM3	BM5	CM5
Adquirir habilidades na procura, identificación e interpretación de fontes de información económica relevante e do seu contido.	AM4	BM7	CM9
Ser capaz de formular modelos simples de relación das variables económicas, baseados na utilización de instrumentos técnicos.	AM8	BM12	CM10
Evaluar, utilizando técnicas empíricas, as consecuencias de distintas alternativas de acción e seleccionar as máis idóneas.	AM10		
	AM12		
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. Estacionariedade. Contrastes de raíces unitarias. 3.4. Cointegración. 3.5. Regresións espurias. 3.6. Introdución a modelos VAR. 3.7. 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 econométricos (aplicable a temas 1, 2 e 5).	Manexo de distintos paquetes econométricos.

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 B2 B7 C4 C5	6	4	10
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	
Metodoloxías	Descrición
Prácticas a través de TIC	Os estudantes 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 estudantes 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 dúbidas ou dificultades coas que se atopen os estudantes en relación ás distintas actividades de avaliación (individuais ou en grupo). Desta forma se crea un debate entre os estudantes, 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.
Proba obxectiva	Prueba 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	Descrición

Prácticas a través de TIC Traballos tutelados Obradoiro	* Prácticas a través de TIC Para a realización destas actividades os estudantes precisan o asesoramento e, no seu caso, a dirección do docente. * Traballos tutelados Os estudantes 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 dúbidas ou dificultades coas que se atopen os estudantes en relación ás distintas actividades de avaliación (individuais ou en grupo).

Avaliación			
Metodoloxías	**Competencias**	**Descrición**	**Cualificación**
Proba obxectiva	A4 A1 A3 A8 A12 B2 B5 B7 B12 C4 C5 C10	Exame escrito	40
Traballos tutelados	A4 A1 A3 A8 A12 B2 B5 B7 B12 C4 C5 C9 C10	Exercicios aplicados	15
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 2019/2020, 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 2019, 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 propias 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%, mentras 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 estudante será o resultado de ponderar as cualificacións obtidas en cada unha das partes.

———

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.- 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.
Bibliografía complementaria	

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, aínda que non imprescindible, 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 estudantado. Asimesmo, recoméndase posuir coñecementos de inglés, especialmente na comprensión lectora, xa que unha parte importante do material que se facilitará ao estudante está nesta lingua.

(*)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