

GUIA DOCENTE DE LA ASIGNATURA

ECONOMETRÍA

Aprobada en Consejo de Departamento el día 19/09/2012.

MÓDULO	MATERIA	CURSO	SEMESTRE	CRÉDITOS	TIPO
Métodos cuantitativos	Econometría	3º	5º	6	Obligatoria
PROFESOR(ES)			DIRECCIÓN COMPLETA DE CONTACTO PARA TUTORÍAS (Dirección postal, teléfono, correo electrónico, etc.)		
Grupo A Chica Olmo, Jorge Grupo B Fernández Sánchez, Pilar			Departamento de Métodos Cuantitativos para la Economía y la Empresa. Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales. Campus de Cartuja s/n. 18011 Granada. Teléfono 958 240 619 Fax 958 240 620 Prof. Chica Olmo: jchica@ugr.es Despacho C-216. Tfno. 958 244 111 Profª. Fernández Sánchez: pilarfs@ugr.es Despacho C-212. Tfno. 958 249 921		
			HORARIO DE TUTORÍAS		
			Prof. Chica Olmo: Lunes y miércoles 9: 30-10: 30 y 12: 30-14; 30 Profª. Fernández Sánchez: Martes 12-15. Miércoles 12-15		
GRADO EN EL QUE SE IMPARTE			OTROS GRADOS A LOS QUE SE PODRÍA OFERTAR		
Grado en Marketing e Investigación de Mercados			Grado en Administración y Dirección de Empresas Grado en Finanzas y Contabilidad		
PRERREQUISITOS Y/O RECOMENDACIONES (si procede)					
Se recomienda tener adquiridos los conocimientos de Matemáticas, de Estadística y Economía del Módulo de Formación básica					
BREVE DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS (SEGÚN MEMORIA DE VERIFICACIÓN DEL GRADO)					
<ul style="list-style-type: none"> Naturaleza de la Econometría El método econométrico. 					


 ugr | Universidad
de Granada

Página 1

 INFORMACIÓN SOBRE TITULACIONES DE LA UGR
<http://grados.ugr.es>

Firmado por: ROSA MARÍA GARCÍA FERNANDEZ Secretario/a de Departamento

Sello de tiempo: 12/03/2019 12:24:10 Página: 1 / 6



aFHTibetGdF64H0KHLEPSn5CKCJ3NmbA

 La integridad de este documento se puede verificar en la dirección <https://sede.ugr.es/verifirma/pfinicio.jsp> introduciendo el código de verificación que aparece debajo del código de barras.

- Resultados matemáticos y estadísticos en forma matricial.
- El modelo lineal general: especificación y estimación mínimo-cuadrática
- El modelo lineal general normal: estimación máximo verosímil, verificación y explotación
- Estimación con información a priori exacta
- Multicolinealidad
- Variables ficticias
- Modelos con matriz de varianzas y covarianzas no escalar
- Heterocedasticidad
- Autocorrelación

COMPETENCIAS GENERALES Y ESPECÍFICAS

Capacidad de análisis y síntesis
 Habilidad para analizar y buscar información proveniente de fuentes diversas
 Capacidad para gestionar la información
 Capacidad para adquirir un compromiso ético en el trabajo
 Capacidad de aprendizaje y trabajo autónomo
 Capacidad para aplicar los conocimientos a la práctica

Específicas

- Conocer y comprender la realidad económica, identificar el papel que desempeñan las empresas dentro de la economía, conocer las distintas formas que pueden adoptar las empresas.
- Conocer las técnicas matemáticas y estadísticas básicas aplicadas al ámbito económico-empresarial, y analizar cuantitativamente la realidad económico-empresarial e Interrelacionar los conocimientos adquiridos en diversas materias de la titulación en el ámbito matemático, estadístico y de la teoría económica
- Conocer y aplicar los conceptos teóricos y/o las técnicas instrumentales y herramientas para la resolución de problemas económicos y situaciones reales
- Utilizar herramientas básicas de naturaleza cuantitativa, de cálculo y para el diagnóstico y análisis
- Aprender a identificar y cuantificar relaciones de comportamiento entre variables
- Ser capaz de modelizar situaciones empresariales

OBJETIVOS (EXPRESADOS COMO RESULTADOS ESPERABLES DE LA ENSEÑANZA)

El alumno sabrá / comprenderá:

- Conocer la técnica de Regresión a la hora de cuantificar las relaciones existentes entre magnitudes de tipo económico.
- Plasmar en una ecuación de regresión una proposición de tipo económico.
- Los distintos métodos de estimación disponibles, así como las propiedades de esas estimaciones
- La validez de los resultados obtenidos por los modelos econométricos, en función de la adecuación de los supuestos en que se basan al tipo de problema tratado

El alumno será capaz de:

- Estimar los parámetros de un modelo de regresión Lineal
- Validar hipótesis lineales acerca de las proposiciones que sobre los parámetros proponen los modelos teóricos
- Efectuar predicciones acerca de los valores futuros de las variables dependientes, valorando su fiabilidad.

TEMARIO DETALLADO DE LA ASIGNATURA



ugr | Universidad
de Granada

Página 2

INFORMACIÓN SOBRE TITULACIONES DE LA UGR
<http://grados.ugr.es>

Firmado por: ROSA MARÍA GARCÍA FERNANDEZ Secretario/a de Departamento

Sello de tiempo: 12/03/2019 12:24:10 Página: 2 / 6



aFHTibetGdF64H0KHLEPSn5CKCJ3NmbA

La integridad de este documento se puede verificar en la dirección <https://sede.ugr.es/verifirma/pfinicio.jsp> introduciendo el código de verificación que aparece debajo del código de barras.

1. Introducción a la Econometría

- 1.1 Econometría y modelos econométricos
- 1.2 Fases del método econométrico y componentes de un modelo econométrico
- 1.3 Naturaleza de la información utilizada en Econometría

2. El modelo lineal I.

- 2.1 Hipótesis del modelo
- 2.2 Estimación de los parámetros del modelo por mínimos cuadrados ordinarios. Propiedades.
- 2.3 Estimación mediante intervalos de confianza de los parámetros del modelo

3. El modelo lineal II

- 3.1 Contrastes de hipótesis acerca de los parámetros del modelo
- 3.2 Bondad de ajuste: coeficientes de determinación y criterios de Akaike y Schwarz
- 3.3 Explotación del modelo

4. Multicolinealidad

- 4.1 Concepto, causas y consecuencias
- 4.2 Procedimientos de detección de multicolinealidad en la muestra
- 4.3 Soluciones al problema de la multicolinealidad

5. Heteroscedasticidad

- 5.1 Concepto, causas y consecuencias
- 5.2 Procedimientos de detección: contrastes de Goldfeld-Quandt, de Breusch-Pagan y de Glejser
- 5.3 Estimación de modelos con heteroscedasticidad

6. Autocorrelación

- 6.1 Concepto, causas y consecuencias
- 6.2 Procedimientos de detección: prueba h de Durbin y contrastes de Durbin-Watson y de Ljung-Box
- 6.3 Estimación de modelos con perturbaciones autocorrelacionadas

TEMARIO PRÁCTICO: Coincide con el teórico con la salvedad de que, en el tema 2, se incluyen ejercicios de estimación de modelos utilizando variables ficticias

BIBLIOGRAFÍA

ugr | Universidad
de Granada

Página 3

INFORMACIÓN SOBRE TITULACIONES DE LA UGR
<http://grados.ugr.es>

Firmado por: ROSA MARÍA GARCÍA FERNANDEZ Secretario/a de Departamento

Sello de tiempo: 12/03/2019 12:24:10 Página: 3 / 6



aFHTibetGdF64H0KHLEPSn5CKCJ3NmbA

La integridad de este documento se puede verificar en la dirección <https://sede.ugr.es/verifirma/pfinicio.jsp> introduciendo el código de verificación que aparece debajo del código de barras.

BIBLIOGRAFIA BÁSICA

ALONSO, A.; FERNÁNDEZ, J. y GALLASTEGUI, I. (2005).- Econometría. Ed. Prentice Hall
 CARIDAD, J.M. (1998). Econometría: Modelos Econométricos uniecuacionales. Ed. Reverté S.A.
 GREENE, W (1999).- Análisis Económico. Ed. Prentice Hall
 GUISAN, M.C. (1997).- Econometría. Ed. McGraw Hill
 GUJARATI, D. (2010).- Econometría.- Ed. McGraw Hill
 JOHNSTON, J.(1987).- Econometría. Ed. McGraw Hill
 JOHNSTON, J. y DINARDO, J (2001).- Métodos de Econometría.- Ed Vicens-Vives
 MADDALA, G.S. (2001).- Econometría. Ed. McGraw Hill
 MARTÍN, G. LABEAGA, J.M. y MOCHÓN, F. (1997).- Introducción a la Econometría. Prentice Hall
 NOVALES, A. (2000).- Econometría. 2ª Edic. McGraw Hill.
 PALACIOS, F. GARCÍA, R.M. y HERRERIAS, J.M. (2011).- Ejercicios de Econometría 1. Ediciones Pirámide.
 PINDYCK, R.S. y RUBINFELD, D.L. (2001).- Econometría, modelos y pronósticos. Ed. McGraw Hill
 PULIDO, A. y PÉREZ, J. (2001).- Modelos Econométricos.- Ed Pirámide.
 SCHMIDT, S.J. (2005).- Econometría. Ed. McGraw Hill
 SÁNCHEZ, C. (1999) Métodos Econométricos. Ariel Economía. Barcelona.
 STEWART, M.B. y WALLIS, K.F. (1984).- Introducción a la Econometría. Alianza Universidad.
 STOCK, J.H. y WATSON, M.M. (2012) Introducción a la Econometría, 3ª ed. Pearson
 WOOLDRIDGE, J.M. (2010).- Introducción a la Econometría. Un enfoque moderno. 2ª Edic. Thomson

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTARIA

AZNAR, A.; GARCÍA, A. y MARTÍN, A. (1994).- Ejercicios de Econometría I. Ed. Pirámide
 FERNÁNDEZ, A.I. y otros (1995).- Ejercicios de Econometría. Ed. McGraw Hill
 GONZÁLEZ, S. (Coordinadora) (2007). Ejercicios resueltos de Econometría. El modelo de regresión múltiple. Delta Publicaciones.
 HERNÁNDEZ, J. (1989).- Ejercicios de Econometría. Ed. ESIC
 PENA, J,B y otros (1999).- Cien Ejercicios de Econometría. Ed. Pirámide
 PÉREZ, T.; AMOROS, P. y RELLOSO, S. (1993).- Ejercicios de Econometría Empresarial. Ed. McGraw Hill

ENLACES RECOMENDADOS

Web del Dpto. de Métodos Cuantitativos para la Economía y la Empresa. <http://metodoscuantitativos.ugr.es/>
 Instituto nacional de Estadística. <http://www.ine.es/>
 Instituto de estadística andaluz. <http://www.juntadeandalucia.es:9002/>
 Banco de España. <http://www.bde.es/webbde/es/>
 Bolsa de Madrid. <http://www.bolsamadrid.es/homei.htm>
 Anuario Económico de La Caixa. <http://www.anuarieco.lacaixa.comunicacions.com>
 Eurostat, <http://epp.eurostat.ec.europa.eu/portal/page/portal/eurostat/home/>.
 Descarga gratuita del programa Gretl: <http://descargar.portalprogramas.com/gretl.html>,
<http://gretl.softonic.com/>

METODOLOGÍA DOCENTE

Esta asignatura está basada en clases presenciales en las que se explican los contenidos teóricos y se realizan numerosos ejercicios prácticos. A través de las referencias citadas anteriormente, el alumno dispone de una gran variedad de ejercicios resueltos, los cuales ayudan a interpretar, resolver y discutir los contenidos teóricos/prácticos explicados. Los alumnos disponen de otros recursos docentes: resolución de ejercicios mediante distintos paquetes informáticos, preferiblemente de libre disposición como por ejemplo Gretl o bien lo suficientemente utilizados, como por ejemplo Excel.



ugr | Universidad
de Granada

Página 4

INFORMACIÓN SOBRE TITULACIONES DE LA UGR
<http://grados.ugr.es>

Firmado por: ROSA MARÍA GARCÍA FERNANDEZ Secretario/a de Departamento

Sello de tiempo: 12/03/2019 12:24:10 Página: 4 / 6



aFHTibetGdF64H0KHLEPSn5CKCJ3NmbA

La integridad de este documento se puede verificar en la dirección <https://sede.ugr.es/verifirma/pfinicio.jsp> introduciendo el código de verificación que aparece debajo del código de barras.

- El profesor o Profesora
- 1) Introducirá los contenidos correspondientes a cada tema y los desarrollará de la forma más oportuna dependiendo del grado de complejidad.
 - 2) Realizará las demostraciones que sean necesarias para el desarrollo de la materia y al objeto de que el alumno aprenda a "enfrentarse" a ellas y a otras similares.
 - 3) Resolverá ejercicios a modo de ejemplo y planteará otros para entender y afianzar mejor los conceptos.
 - 4) Pedirá al alumno que busque problemas que se pueden plantear en asignaturas que esté cursando en ese momento e incluso problemas que se le puedan plantear en el desarrollo de su futura actividad profesional.
 - 5) Suministrará enunciados de ejercicios para que los alumnos practiquen por su cuenta.
 - 6) Durante la clase se responderán las preguntas y dudas que se planteen. Las correspondientes al trabajo individual del alumno se resolverán en horas de tutoría.

PROGRAMA DE ACTIVIDADES

Primer cuatrimestre	Temas del temario	Actividades presenciales (NOTA: Modificar según la metodología docente propuesta para la asignatura)						Actividades no presenciales (NOTA: Modificar según la metodología docente propuesta para la asignatura)			
		Sesiones teóricas (horas)	Sesiones prácticas (horas)	Exposiciones y seminarios (horas)	Tutorías colectivas (horas)	Exámenes (horas)	Etc.	Tutorías individuales (horas)	Estudio y trabajo individual del alumno (horas)	Trabajo en grupo (horas)	Etc.
Semana 1	1	2	1						6		
Semana 2	2	2	1						6		
Semana 3	2	2	1						6		
Semana 4	2	2	1						6	3	
Semana 5	3	2	1						6		
Semana 6	3	2	1						6		
Semana 7	3	2	1		1				6		
Semana 8	3	1,5	0,5			1			6	3	
Semana 9	4	2	1						6		
Semana 10	4	2	1						6		
Semana 11	5	2	1						6		
Semana 12	5	2	1						6		
Semana 13	6	2	1						6		



ugr | Universidad
de Granada

Página 5

INFORMACIÓN SOBRE TITULACIONES DE LA UGR
<http://grados.ugr.es>

Firmado por: ROSA MARÍA GARCÍA FERNANDEZ Secretario/a de Departamento

Sello de tiempo: 12/03/2019 12:24:10 Página: 5 / 6



aFHTibetGdF64H0KHLEPSn5CKCJ3NmbA

La integridad de este documento se puede verificar en la dirección <https://sede.ugr.es/verifirma/pfinicio.jsp> introduciendo el código de verificación que aparece debajo del código de barras.

Semana 14	6	2	1		1				6	3	
Semana 15	Repaso	1,5	0,5			1			6		
						Examen oficial: 2'5		1 (cada alumno)			
Total horas		29	14		2	5		1	90	9	

EVALUACIÓN (INSTRUMENTOS DE EVALUACIÓN, CRITERIOS DE EVALUACIÓN Y PORCENTAJE SOBRE LA CALIFICACIÓN FINAL, ETC.)

Con objeto de evaluar la adquisición de los contenidos y competencias a desarrollar en la materia, se utilizará un sistema de evaluación diversificado, seleccionando las técnicas de evaluación más adecuadas para la asignatura en cada momento, que permita poner de manifiesto los diferentes conocimientos y capacidades adquiridos por el alumnado al cursar la asignatura.

De entre las siguientes técnicas evaluativas se utilizarán alguna o algunas de ellas.

Prueba escrita: exámenes de ensayo, pruebas objetivas, resolución de problemas, casos o supuestos, pruebas de respuesta breve, informes y diarios de clase.

Prueba oral: exposiciones de trabajos orales en clase, individuales o en grupo, sobre contenidos de la asignatura (seminario) y sobre ejecución de tareas prácticas correspondientes a competencias concretas.

Observación: escalas de observación, en donde se registran conductas que realiza el alumno en la ejecución de tareas o actividades que se correspondan con las competencias.

Técnicas basadas en la asistencia y participación activa del alumno en clase, seminarios y tutorías: trabajos en grupos reducidos sobre supuestos prácticos propuestos.

El sistema de calificaciones se expresará mediante calificación numérica de acuerdo con lo establecido en el art. 5 del R. D 1125/2003, de 5 de septiembre, por el que se establece el sistema europeo de créditos y el sistema de calificaciones en las titulaciones universitarias de carácter oficial y validez en el territorio nacional. Para superar la asignatura será necesario que en las pruebas escritas se obtenga una puntuación media mínima de cinco puntos, en la escala de cero a diez.

La calificación global corresponderá a la puntuación ponderada de los diferentes aspectos y actividades que integran el sistema de evaluación:

Prueba escrita que constará de parte teórica y parte práctica 70%

Evaluación continua y pruebas de clases prácticas, Trabajos valorados positivamente, ... 30%

INFORMACIÓN ADICIONAL



ugr | Universidad
de Granada

Página 6

INFORMACIÓN SOBRE TITULACIONES DE LA UGR
<http://grados.ugr.es>

Firmado por: ROSA MARÍA GARCÍA FERNANDEZ Secretario/a de Departamento

Sello de tiempo: 12/03/2019 12:24:10 Página: 6 / 6



aFHTibetGdF64H0KHLEPSn5CKCJ3NmbA

La integridad de este documento se puede verificar en la dirección <https://sede.ugr.es/verifirma/pfinicio.jsp> introduciendo el código de verificación que aparece debajo del código de barras.