

PROGRAMA DE ASIGNATURA

Titulación				Curso académico
204.1 F. CC.EE.Y EMPRESA.- ADMON.Y DIR.EMPRESAS				2008/09
Código y título de la asignatura				
24227 Econometría I				
Tipo	Idioma	Créditos UD	Créditos ECTS	Temporalidad
TRONCAL	SPA-EUS	4,5	4	Semestre 1

JUSTIFICACION

En la gestión de empresas es preciso tener en cuenta que muchos problemas requieren un análisis riguroso y una formulación que básicamente se materializa en una definición y selección de variables y en la búsqueda de asociaciones y relaciones de causalidad entre las mismas. La Econometría es un instrumento que sirve para huir de la superficialidad y buscar el contraste riguroso.

PRERREQUISITOS

Conocimiento básico de álgebra matricial. Estadística descriptiva para resumir la información numérica. Variables aleatorias (discretas y continuas) y distribuciones de probabilidad. Estimación por intervalos. Contrastes de hipótesis. Regresión lineal simple.

RESULTADO DE APRENDIZAJE EN TERMINOS DE COMPETENCIAS GENERICAS Y ESPECIFICAS

Al final de la asignatura el alumno:

- Debe ser capaz de utilizar correctamente el lenguaje propio de la Econometría.
- Debe ser capaz, asimismo, de conocer la sintaxis del lenguaje, es decir la ordenación y la relación entre los conceptos que permiten formular y resolver microejercicios manualmente.
- Debe ser capaz de manejar software específico y saber interpretar correctamente sus resultados.

CONTENIDOS

Tema 1. El modelo general de regresión lineal multivariante

- 1.1. El modelo general de regresión lineal multivariante.
- 1.2. Estimación de los parámetros.
- 1.3. Las hipótesis de Gauss-Markov y el error estándar de la estimación.
- 1.4. Análisis de correlación en regresión múltiple.
- 1.5. Pruebas de hipótesis y significación de los parámetros.
- 1.6. Predicción.
- 1.7. Prueba para detectar autocorrelación.
- 1.8. Modelos no lineales.
- 1.9. Los programas de regresión múltiple
- 1.10. Aplicaciones con EXCEL y SPAD

Tema 2. Análisis de la varianza

- 2.1. Presentación del análisis simple (ANOVA).
- 2.2. Análisis de la varianza de un factor.
- 2.3. Análisis de la varianza de dos factores sin interacción.
- 2.4. Dos factores e interacción.
- 2.5. Aplicaciones del ANOVA con EXCEL y SPAD.
- 2.6. Presentación del análisis múltiple de varianza (MANOVA).

Tema 3. El enfoque espacial de los datos

- 3.1. La matriz de datos
- 3.2. Las distancias.
- 3.3. El producto escalar.
- 3.4. Diagonalización de una matriz y significado geométrico.
- 3.5. La inercia en análisis de datos.

ESTRATEGIA DE ENSEÑANZA-APRENDIZAJE

La metodología trata de ajustarse naturalmente a los objetivos antes señalados para el curso y tiene dos vertientes equiparables en importancia y dedicación: la fundamentación conceptual y matemática por un lado, y la ejercitación práctica, tanto sobre el papel como con las aplicaciones en el ordenador, en cuyo uso los alumnos formarán equipos de tres personas por máquina. En líneas generales, el alumno dedica un 50% del tiempo a la asistencia a clase y el otro 50% al trabajo personal. A su vez, dentro del 50% de horas lectivas, dos tercios son clases magistrales y el otro tercio clases prácticas (ejercicios y manejo de software). En lo que se refiere al otro 50% de trabajo personal fuera del horario de clases, aproximadamente un 85% es trabajo individual y el otro 15% trabajo obligatorio en equipo.

SISTEMA DE EVALUACION

Los equipos formados por tres alumnos tendrán la oportunidad de presentar un trabajo de aplicación de un caso práctico, cuya calificación supondrá un 20% de la nota final, correspondiendo el 80% de dicha nota a la calificación del examen escrito. La aplicación de esta media ponderada se llevará a cabo siempre que no sea en detrimento de la nota conseguida en el examen.

DOCUMENTACION

Texto principal de referencia:

LÓPEZ DE VICUÑA ARCAUZ, F. (2005), *Econometría empresarial. Análisis de datos, tomo I*, Ediciones ESTE ¿, Universidad de Deusto, San Sebastián.

Bibliografía básica complementaria:

GUISÁN, M.C. (1997), *Econometría*, McGraw-Hill.

HERNÁNDEZ ALONSO, J. (1992), *Ejercicios de econometría*, ESIC Editorial.

LÉBART, L., MORINEAU, A., FENELOS, J.P. (1985), *Tratamiento estadístico de datos*, Marcombo Boixareus Editores.

MARTÍN, G., LABEAGA, J.M., MOCHÓN, F. (1997), *Introducción a la econometría*, Prentice Hall.

NOVALES, A., (1996), *Estadística y econometría*, McGraw-Hill.

PENA, J.B., ESTAVILLO, J.A., GALINDO, M.E., LECETA, M.J., ZAMORA, M.M. (1999), *Cien ejercicios de econometría*, Pirámide.

Plataforma:

Bibliografía y fuentes de Internet para la presentación de casos prácticos resueltos con ordenador.

Software:

Excel y SPAD