

**FICHA IDENTIFICATIVA****DATOS DE LA ASIGNATURA****Código:** 35942**Nombre:** Econometría**Ciclo:** Grado**Créditos ECTS:** 4,5**Curso académico:** 2026-27**TITULACIONES**

Titulación	Centro	Curso	Periodo
1315 - Grado en Finanzas y Contabilidad	Facultat d'Economia	2	Segundo cuatrimestre

MATERIAS

Titulación	Materia	Carácter
1315 - Grado en Finanzas y Contabilidad	Econometría	OBLIGATORIA

COORDINACIÓN

SERRANO DOMINGO GUADALUPE

RESUMEN

La asignatura de Econometría se imparte en el segundo semestre del segundo curso del grado de Finanzas y Contabilidad, enmarcándose en el conjunto de materias que los estudiantes han de cursar del módulo de Métodos Cuantitativos. Tiene carácter obligatorio y semestral, con una carga lectiva total de 4,5 créditos (1,5 teóricos y 3 informáticos/prácticos).

El objetivo de la asignatura es proporcionar a los estudiantes los conocimientos básicos de una disciplina académica como es la Econometría, que aúna conceptos provenientes de la Teoría Económica, de las Matemáticas y de la Estadística y cuyo fin será dotar al estudiante de unos instrumentos analíticos y cuantitativos adecuados para abordar el análisis de la realidad económica - financiera y empresarial. La formulación y contrastación de hipótesis acerca del funcionamiento de esa realidad, así como la realización de predicciones acerca de su futuro inmediato serán el objeto de estudio en esta materia.

Como disciplina de carácter matemático-estadístico, los estudiantes deberán utilizar los conocimientos previos de cálculo y estadística que ya poseen de otras materias. Es, por lo tanto, una asignatura



formativa con un amplio espectro de contenidos teóricos/prácticos que se apoya en habilidades previas de los estudiantes y que les permite, con el apoyo de ciertas herramientas informáticas, obtener una visión integral de los instrumentos de análisis cuantitativos empleados en el estudio y predicción de la realidad económica y empresarial.

El contenido esencial de la asignatura se centra fundamentalmente en el desarrollo del modelo de regresión lineal, sus hipótesis y problemas asociados. No obstante, en el programa también se incluye un tema esencial en el campo de las finanzas como es el estudio de las series temporales, su concepto y estimación, si bien con carácter introductorio. Por consiguiente, el programa de la asignatura se divide en tres grandes bloques: modelo de regresión lineal, incumplimiento de las hipótesis básicas en dicho modelo e introducción a las series temporales.

ute;sicas en dicho modelo e introducción a las series temporales.

e>

p>e>

nbsp;

CONOCIMIENTOS PREVIOS

RELACIÓN CON OTRAS ASIGNATURAS DE LA MISMA TITULACIÓN

No se han especificado restricciones de matrícula con otras asignaturas del plan de estudios.

OTROS TIPOS DE REQUISITOS

Sin requisitos previos. Se recomienda haber cursado las materias de Matemáticas I y II y Estadística I de primer curso, así como la de Estadística II de segundo curso, primer semestre.

COMPETENCIAS / RESULTADOS DE APRENDIZAJE

1315 - Grado en Finanzas y Contabilidad

CM3FYC 1 Conocer el lenguaje estadístico y las capacidades y límites del modelo estadístico para describir una situación financiera y empresarial.

CM3FYC 2 Conocer y comprender las herramientas estadísticas y econométricas básicas para la



presentación, análisis, diagnóstico y prospección de resultados financieros y empresariales.

DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS

1. BLOQUE I. EL MODELO DE REGRESIÓN LINEAL :

En este primer bloque se introduce el concepto de econometría y se analiza con detalle la que será la referencia básica de este programa: el modelo de regresión lineal. En este sentido, se analizan las hipótesis básicas y propiedades de este modelo, así como todas las etapas de su elaboración desde la perspectiva de la modelización econométrica, esto es, su estimación, validación y predicción. Asimismo, se analizan todas las implicaciones que de él se derivan cuando incorporamos al modelo información cualitativa.

Tema 1. Modelos econométricos y datos económicos

- 1.1. Concepto de econometría.
- 1.2. Etapas en la modelización econométrica.
- 1.3. Datos económicos.

Tema 2. El modelo de regresión lineal

- 2.1. El modelo de regresión lineal simple.
- 2.2. El modelo de regresión lineal múltiple.
- 2.3. Interpretación de coeficientes: la cláusula *ceteris paribus*
- 2.4. Unidades de medida y formas funcionales.

Tema 3. Contraste de hipótesis

- 3.1. Propiedades del modelo de regresión.
- 3.2. Medidas de bondad del ajuste.
- 3.3. Contrastes de hipótesis.
- 3.4. Predicción.

Tema 4. Análisis de regresión múltiple con información cualitativa

- 4.1. Las variables ficticias.
- 4.2. Interpretación de coeficientes de variables ficticias.
- 4.3. Múltiples categorías.
- 4.4. Interacciones de ficticias.

2. BLOQUE II. AMPLIACIÓN DEL MODELO LINEAL BÁSICO

Este bloque revisa los problemas y soluciones del modelo de regresión lineal cuando se incumplen algunas de sus hipótesis básicas.

Tema 5. Incumplimiento de las hipótesis básicas.

- 5.1. Multicolinealidad y errores de especificación.
- 5.2. Normalidad.
- 5.3. Heterocedasticidad.
- 5.4. Autocorrelación.



3. BLOQUE III. INTRODUCCIÓN A LAS SERIES TEMPORALES

Este bloque se centra en el marco de la predicción en contextos de incertidumbre, con un tipo de datos específico del análisis financiero, como es el de los datos de serie temporal. Un análisis introductorio de sus componentes, así como de la estimación de las mismas será el objeto de este tema.

Tema 6. Series temporales

6.1. Introducción al análisis de series temporales.

6.2. Componentes no observables de una serie temporal.

VOLUMEN DE TRABAJO (HORAS)

ACTIVIDADES PRESENCIALES

Actividad	Horas
Teoría	15,00
Aula informática	30,00
Total horas	45,00

ACTIVIDADES NO PRESENCIALES

Actividad	Horas
Asistencia a otras actividades	0,00
Elaboración de trabajos individuales o en grupo	13,50
Estudio y trabajo autónomo	10,00
Preparación de clases	23,00
Preparación de actividades de evaluación	12,00
Resolución de casos prácticos	9,00
Total horas	67,50

METODOLOGÍA DOCENTE

La metodología para impartir la asignatura de Econometría, tanto en las clases teóricas como prácticas, irá orientada a combinar una visión teórica de la materia, basada en la presentación, desarrollo y conocimiento de ciertos conceptos básicos, con un aprendizaje también muy práctico, basado en el uso de instrumentos empíricos que permitan el análisis de diversos casos reales y prácticos bajo distintos escenarios. De forma más precisa, describimos esta doble tipología de la metodología a continuación.



En las sesiones teóricas se combinará el diseño de clase magistral con la participación activa del estudiante en clase (planteamiento de dudas que puede contestar el profesor y/o sus compañeros, resolución de cuestiones breves planteadas por el profesor, discusión en grupo de los aspectos que han suscitado mayor interés e incluso pequeñas pruebas de repaso). Con ello se pretende que el estudiante desarrolle tanto su capacidad de trabajo autónomo, como su capacidad de defender ideas y su capacidad de comunicación oral y escrita (planteando sus dudas sobre el tema en público y/o resolviendo por escrito las cuestiones que se le han planteado).

Un buen seguimiento de las clases teóricas exigirá que el estudiante prepare con antelación las lecturas que sirvan de base para la explicación teórica, así como las principales dudas que surjan de dichas lecturas. En este contexto, el alumno dispondrá de una bibliografía básica recomendada acorde al nivel del curso, así como de ciertas lecturas complementarias que le permitirán seguir sin problemas los diferentes contenidos del mismo. Igualmente, tendrá acceso a cierto material adicional (transparencias, problemas teóricos, ejercicios resueltos y casos prácticos) en el aula virtual de la Universidad.

caso y se considerase oportuno por parte del profesor acompañar el formato escrito del mismo con una presentación oral.

EVALUACIÓN

En la asignatura se utilizará el siguiente procedimiento de evaluación:

- Prueba de síntesis (70% de la nota final): Prueba escrita (examen) que constará de cuestiones teóricas y/o teórico-prácticas y/o de problemas sobre el contenido de la asignatura.
- Evaluación continua del estudiante a partir de la resolución de ejercicios y la elaboración de trabajos (30% de la nota final). Dicha evaluación consistirá en la realización y presentación de ejercicios tanto analíticos como con ordenador para cada tema que irá unida a la participación del estudiante en las clases prácticas, así como a la entrega de cualquier otro trabajo que el profesor estime conveniente realizar a lo largo del semestre. Esta evaluación continua es de carácter no recuperable, si bien su calificación podrá guardarse hasta la segunda convocatoria en caso de que el estudiante no supere la prueba de síntesis en la primera.

La nota final será la suma ponderada de la prueba de síntesis y de la evaluación continua (no recuperable).



Para sumar la evaluación continua es imprescindible superar la prueba de síntesis.

En caso de no superar la prueba de síntesis, la nota que figurará en actas será la nota obtenida en dicha prueba (calculada sobre 10).

El alumno bajo sospecha de intento de copia, plagio o suplantación en la realización de las entregas o del examen tendrá una nota final de cero.

La normativa oficial del centro respecto a evaluación y calificación de asignaturas puede consultarse en el siguiente enlace:

https://www.uv.es/graus/normatives/2017_108_Reglament_avaluacio_qualificacio.pdf

BIBLIOGRAFÍA

- Carter Hill, R.; Griffiths, W. E. & Lim G.C. (2012): Principles of Econometrics. Fourth Edition. John Wiley & Sons. Inc.
- Contreras, D. y Belaire, J. (2000): Introducció a l'Econometria. Educació. Materials 36. Universitat de València.
- Gujarati, D. y Porter D.C. (2010) Econometría (5ª Edición). McGraw-Hill.
English version: Gujarati, D. and Porter D.C. (2009) Basic Econometrics, (5th Edition). McGraw-Hill
- Stock J.H. y Watson M.M. (2012) Introducción a la Econometría. (3ª Edition). Pearson
English version: Stock J.H. y Watson M.M. (2020) Introduction to Econometrics. (4th Edition, Global Edition). Pearson.
- Wooldridge, J (2016). Introducción a la econometría. 5ª Edición. Cengage Learning. English version: Wooldridge, J (2020). Introductory Econometrics: A Modern Approach 7th Edition. Cengage Learning

Recurso en línea, libre acceso

<https://www.uv.es/uriel/manual/Introducci%C3%B3n%20a%20la%20econometr%C3%ADa%2012-09-2019%20B.pdf>