

Guía docente

Identificación de la asignatura

Asignatura / Grupo	20623 - Macroeconomía / 42
Titulación	Doble titulación: Grado en Economía y Grado en Turismo (Pla 2015) - Cuarto curso Doble titulación: Grado en Economía y Grado en Turismo - Tercer curso Grado en Economía - Tercer curso
Créditos	6
Período de impartición	Primer semestre
Idioma de impartición	Castellano

Profesores

Horario de atención a los alumnos

Profesor/a	Hora de inicio	Hora de fin	Día	Fecha inicial	Fecha final	Despacho / Edificio
Heiko Jürgen Rachinger - heiko.rachinger@uib.es	15:00	16:00	Miércoles	11/09/2019	30/06/2020	DB210

Contextualización

La asignatura de Macroeconomía es una asignatura de carácter obligatorio, dentro del módulo de formación básica sobre Métodos Económicos Cuantitativos. La asignatura tiene un total de seis temas, divididos en dos partes. La primera parte, consta de tres temas, dedicados a los modelos de series temporales, modelos dinámicos y modelos VAR. La segunda parte, también tiene tres temas, dedicados a las tendencias deterministas y estocásticas, los contrastes de raíces unitarias y estacionariedad y a las relaciones espurias y cointegración. El curso es especialmente útil para introducir al alumno en algunas de herramientas más utilizadas en trabajos empíricos de investigación en los que se utilizan datos macroeconómicos.

En el contexto de los Métodos Económicos Cuantitativos, el curso de Macroeconomía se presenta como la continuación de la formación estadística y econométrica básica que se ha proporcionado en las asignaturas de Análisis de Datos e Introducción a la Econometría. Concretamente, la asignatura introduce al alumno a las herramientas econométricas necesarias para el análisis de los datos macroeconómicos agregados. Con este fin, el curso combina las técnicas econométricas con datos y tópicos de la macro como por ejemplo la histéresis, la paridad del poder adquisitivo, en los que se utilizan las técnicas analizadas en esta asignatura.

Requisitos

Ningún requisito obligatorio.

Recomendables

Se recomienda que para seguir correctamente la asignatura Macroeconomía se hayan cursado las

Guía docente

asignaturas Análisis de Datos Económicos e Introducción a la Econometría.

Competencias

Específicas

- * CE1 y CE2. Contribuir a la buena gestión de la asignación de recursos (tanto en el ámbito privado como en el público), identificando y anticipando problemas económicos relevantes en relación a la asignación de recursos.
- * CE3. Aportar racionalidad al análisis y a la descripción de cualquier aspecto de la realidad económica.

Genéricas

- * CG3. Aplicar al análisis de los problemas criterios profesionales basados en el manejo de instrumentos.
- * CG5. Analizar los problemas con razonamiento crítico, sin prejuicios, con precisión y rigor.
- * CG7. Capacidad de síntesis.

Básicas

- * Se pueden consultar las competencias básicas que el estudiante tiene que haber adquirido al finalizar el grado en la siguiente dirección: http://estudis.uib.cat/es/grau/comp_basiques/

Contenidos

Parte 1. Modelos de series temporales (3 temas)

En esta primera parte el alumno profundizará en el tratamiento de series temporales económicos. En concreto se analiza el tratamiento univariante de series temporales desde un punto de vista estocástico, los modelos dinámicos su topología, el cálculo de multiplicadores, la estimación de modelos dinámicos y finalmente los modelos VAR y la causalidad tipo Granger.

Parte 2: No Estacionariedad y cointegración (3 temas)

En la segunda parte se introduce al alumno en los aspectos relacionados con la no estacionariedad, tendencias deterministas y/o estocásticas, contrastes de raíces unitarias, relaciones espurias y finalmente cointegración.

Contenidos temáticos

Tema 1. Modelos univariantes de series Temporales

- 1.1 Proceso estocástico, serie temporal y estacionariedad.
- 1.2 Función de Autocovarianzas y Autocorrelación Simple y Parcial.
- 1.3 Proceso de Ruido Blanco y Paseo Aleatorio.
- 1.4 Procesos lineales, MA, AR y ARMA
- 1.5 Procesos ARIMA
- 1.6 Metodología Box-Jenkins.
- 1.7 Predicción.

Tema 2. Modelos Dinámicos

- 2.1 Causas que dan lugar a modelos dinámicos.
- 2.2 Modelos de Retardos Distribuidos.
- 2.3 Modelos Autorregresivos.

Guía docente

- 2.4 Modelos AD.
- 2.5 Modelos ARMAX.
- 2.6 Multiplicadores y Análisis Estructural.
- 2.7 Estimación de Modelos Dinámicos. Teorema de Mann-Wald . Variables Instrumentales.
- 2.8 Hipótesis económicas que dan lugar a modelos dinámicos.

Tema 3. Modelos VAR.

- 3.1 Relación con los Modelos de Ecuaciones Simultáneas, forma reducida e estructural.
- 3.2 Especificación y Representación.
- 3.3 Estimación y determinación del orden.
- 3.4 Representación VMA y transmisión de shocks.
- 3.5 Causalidad tipo Granger.

Tema 4. Tendencias Deterministas y Estocásticas.

- 4.1 Tendencia Determinista.
- 4.2 Tendencia Estocástica.
- 4.3 Memoria Transitoria y Permanente.
- 4.4 Trend Stationary y Difference Stationary

Tema 5. Contrastes de Raíces Unitarias y Estacionariedad.

- 5.1 Contrastes de Raíces Unitarias.
 - 5.1.1 ADF.
 - 5.1.2 PP.
 - 5.1.3 MSB.
 - 5.1.4 GLS-ADF
- 5.2 Contrastes de Estacionariedad KPSS.

Tema 6. Cointegración y Relaciones Espurias.

- 6.1 Relaciones Espurias.
- 6.2 Cointegración y Tendencias Comunes, Teorema de la Representación de Granger.
- 6.3 Procedimiento de Johansen.

Metodología docente

Además de fundamentar teóricamente los modelos y técnicas analizadas a lo largo del curso, el alumno se iniciará en su aplicación práctica mediante el uso de programas econométricos específicos.

Volumen

Es recomendable leer el material correspondiente antes de asistir a las clases magistrales, para facilitar el aprendizaje del contenido. También es importante revisar el temario después de cada clase para asegurarse de que todas las dudas se han solucionado. Al finalizar un tema teórico el estudiante realizará ejercicios y prácticas para asimilar y aplicar la teoría expuesta en clase. Una parte de este trabajo se hace en clase, pero es importante que cada estudiante realice también estos estudios fuera de clase.

Actividades de trabajo presencial (1,8 créditos, 45 horas)



Guía docente

Modalidad	Nombre	Tip. agr.	Descripción	Horas
Clases teóricas	Clases magistrales	Grupo grande (G)	Las lecciones magistrales proporcionan una exposición detallada de lo más importante de cada tema, incluyendo conceptos nuevos, ejemplos y ejercicios ilustrativos. Las clases teóricas desarrollan los fundamentos estadísticos y econométricos de los modelos y herramientas analizadas. Una función importante de estas lecciones es la de facilitar que los estudiantes consideren las técnicas y modelos en el contexto del análisis económico aplicado. Por ello, además de fundamentar estadísticamente los modelos mediante su estudio teórico, las clases magistrales inciden en cómo evaluar y analizar los resultados econométricos, derivando a partir de los mismos las principales conclusiones económicas.	20
Clases prácticas	Prácticas presenciales	Grupo mediano (M)	Para complementar la exposición de los temas teóricos, el estudiante realizará ejercicios y prácticas para asimilar y aplicar la teoría analizada en clase. Las sesiones prácticas también incluyen el uso de programas econométricos específicos (Gretl, Econometric Views, Gauss, ...). Especialmente al finalizar cada uno de los temas, el alumno realizará aplicaciones prácticas con datos macroeconómicos reales que ilustren el empleo de las técnicas. Finalmente, también se utilizarán ejercicios de simulación para ilustrar los contenidos teóricos.	20
Evaluación	Examen Final	Grupo grande (G)	Habrà un examen final en la convocatoria oficial y un examen final correspondiente al periodo de recuperación. Esta evaluación permitirá valorar el conocimiento tanto teórico como aplicado del análisis univariante y multivariante de series temporales aplicado a datos macro que abarca el programa (temas 1 a 6). Se valorará de manera objetiva tanto el nivel de conocimiento teórico, como la capacidad del alumno para interpretar y extraer conclusiones de los resultados obtenidos con los modelos y técnicas utilizadas.	2
Evaluación	Examen Parcial (1/2)	Grupo grande (G)	Se realizará dos exámenes parciales durante el curso. En la primera evaluación se valorará el conocimiento de los conceptos, técnicas y modelos expuestos en los dos primeros temas. La prueba será de carácter objetivo, valorándose tanto los conocimientos de tipo teórico, como la capacidad de interpretar y extraer resultados del análisis empírico.	1.5
Evaluación	Examen Parcial (2/2)	Grupo grande (G)	En el segundo examen parcial se valorarán los conocimientos adquiridos en los temas 3, 4 y 5 del programa. La prueba será de carácter objetivo, valorándose tanto los conocimientos de tipo teórico, como la capacidad de interpretar y extraer resultados del análisis empírico.	1.5

Al inicio del semestre estará a disposición de los estudiantes el cronograma de la asignatura a través de la plataforma UIBdigital. Este cronograma incluirá al menos las fechas en las que se realizarán las pruebas de evaluación continua y las fechas de entrega de los trabajos. Asimismo, el profesor o la profesora informará a los estudiantes si el plan de trabajo de la asignatura se realizará a través del cronograma o mediante otra vía, incluida la plataforma Aula Digital.

Actividades de trabajo no presencial (4,2 créditos, 105 horas)

Guía docente

Modalidad	Nombre	Descripción	Horas
Estudio y trabajo autónomo individual o en grupo	Preparación de unidades didácticas	Es recomendable leer el material correspondiente antes que asistir las clases magistrales para facilitar el aprendizaje del contenido. También es importante revisar el temario después de cada clase para asegurarse que todas las dudas se han solucionado. Estudiar la literatura y los recursos ofrecidos por los profesores es importante para profundizar en el aprendizaje y ver el contexto de cada apartado del temario.	55
Estudio y trabajo autónomo individual o en grupo	Solución de ejercicios	Al final de cada tema el estudiante realizará ejercicios y prácticas para asimilar y aplicar la teoría desarrollada en clase. Una parte de este trabajo se hace en clase, pero es importante que cada estudiante también realice los ejercicios fuera de clase. Es aconsejable, pero completamente voluntario, formar grupos para hacer los ejercicios y estudiar de forma más eficiente. Cuando hay dudas, muchas veces, se pueden solucionar en grupo. Si este no es el caso, los horas de tutoría están a disposición de los alumnos.	50

Riesgos específicos y medidas de protección

Las actividades de aprendizaje de esta asignatura no conllevan riesgos específicos para la seguridad y salud de los alumnos y, por tanto, no es necesario adoptar medidas de protección especiales.

Evaluación del aprendizaje del estudiante

La evaluación del aprendizaje consiste en un examen final y una evaluación continua. El estudiante tendrá una calificación numérica entre 0 y 10 para cada una de las actividades evaluadas. La calificación global se calcula teniendo en cuenta los pesos asignados a las diferentes formas de evaluación.

El examen final es un examen escrito que se realiza en Febrero y con otra convocatoria en el periodo de evaluación extraordinaria. A lo largo del semestre se realizan dos sesiones en las que cada estudiante, de forma individual, soluciona ejercicios con entrega al final de la sesión. Las fechas de las sesiones serán concretadas al principio del semestre. Los alumnos que no asistan a la prueba parcial realizada durante el curso tendrán una calificación igual a 0 en dicha prueba. En el caso excepcional y debidamente documentado de que el alumno no pueda asistir a una prueba parcial por citación judicial a su persona, muerte de un familiar de primer grado u hospitalización del propio alumno, el porcentaje de la nota final previsto para dicha prueba parcial será trasladado al examen final.

Alguien que no consiga aprobar el curso en junio tiene la posibilidad de recuperar el examen final. Hay que tener en cuenta que únicamente el examen final es recuperable, pero que su peso en la nota final es sólo del 50%.

Si el alumno ha obtenido una nota final del curso en el periodo de evaluación ordinario igual o superior a 5, no existirá la posibilidad de mejorar su evaluación en el periodo extraordinario.

Fraude en elementos de evaluación

De acuerdo con el artículo 33 del Reglamento Académico, "con independencia del procedimiento disciplinario que se pueda seguir contra el estudiante infractor, la realización demostrablemente fraudulenta de alguno de los elementos de evaluación incluidos en guías docentes de las asignaturas comportará, a criterio del profesor,

Guía docente

una minusvaloración en su calificación que puede suponer la calificación de «suspense 0» en la evaluación anual de la asignatura".

Examen Final

Modalidad	Evaluación
Técnica	Pruebas objetivas (recuperable)
Descripción	Habrà un examen final en la convocatoria oficial y un examen final correspondiente al periodo de recuperación. Esta evaluación permitirá valorar el conocimiento tanto teórico como aplicado del análisis univariante y multivariante de series temporales aplicado a datos macro que abarca el programa (temas 1 a 6). Se valorará de manera objetiva tanto el nivel de conocimiento teórico, como la capacidad del alumno para interpretar y extraer conclusiones de los resultados obtenidos con los modelos y técnicas utilizadas.
Criterios de evaluación	Resolución de ejercicios sobre los conceptos, técnicas y modelos analizados en la asignatura.
Porcentaje de la calificación final:	50%

Examen Parcial (1/2)

Modalidad	Evaluación
Técnica	Pruebas objetivas (no recuperable)
Descripción	Se realizará dos exámenes parciales durante el curso. En la primera evaluación se valorará el conocimiento de los conceptos, técnicas y modelos expuestos en los dos primeros temas. La prueba será de carácter objetivo, valorándose tanto los conocimientos de tipo teórico, como la capacidad de interpretar y extraer resultados del análisis empírico.
Criterios de evaluación	Resolución de ejercicios sobre los conceptos, técnicas y modelos analizados en la asignatura
Porcentaje de la calificación final:	25%

Examen Parcial (2/2)

Modalidad	Evaluación
Técnica	Pruebas objetivas (no recuperable)
Descripción	En el segundo examen parcial se valorarán los conocimientos adquiridos en los temas 3, 4 y 5 del programa. La prueba será de carácter objetivo, valorándose tanto los conocimientos de tipo teórico, como la capacidad de interpretar y extraer resultados del análisis empírico.
Criterios de evaluación	Resolución de ejercicios sobre los conceptos, técnicas y modelos analizados en la asignatura
Porcentaje de la calificación final:	25%

Recursos, bibliografía y documentación complementaria

Además de los libros especificados en la bibliografía, durante todo el curso se pondrá a disposición de los alumnos material específico. Se podrá descargar material adicional de la página Web de la asignatura, donde se encontrarán colgados las prácticas, los ejercicios complementarios, explicaciones más detalladas de algunos temas concretos y también las notas de los alumnos en los trabajos que se vayan realizando a lo largo del curso.

Bibliografía básica

Aznar A. y Trávez, J. (2008): Métodos de predicción en economía. Tomo II. Editorial Ariel. Johnston, J y Dinardo, J. (2001): Métodos de Econometría. Editorial Vicens-Vives. Novales. A. (1993) Econometría.





Guía docente

Editorial McGraw-Hill. Peña, D. (1987) Estadística. Modelos y Métodos 2. Modelos Lineales y Series Temporales. Alianza Universidad.

Bibliografía complementaria

Davidson J. (2000) Econometric Theory. Blackwell Publishers. Hamilton J.D. (1994) Time Series Analysis. Princeton University Press. Hendry D.F. (1995) Dynamic Econometrics. Oxford University Press.

