

Grado en Finanzas y Contabilidad

27510 - Estadística II

Guía docente para el curso 2011 - 2012

Curso: 2, Semestre: 1, Créditos: 6.0

Información básica

Profesores

- **María Asunción Beamonte San Agustín** asunbea@unizar.es
- **Sergio Andrés García** sergioag@unizar.es

Recomendaciones para cursar esta asignatura

La asignatura no tiene establecido ningún requisito previo. Sin embargo, sería conveniente haber cursado las asignaturas de Matemáticas I, Matemáticas II y Estadística I para facilitar el aprendizaje de la misma y necesitar de menor esfuerzo. Es recomendable un conocimiento básico de ofimática, principalmente de un editor de textos y una hoja de cálculo, para realizar las prácticas correctamente y de este modo adquirir algunas competencias importantes.

Actividades y fechas clave de la asignatura

Actividades y fechas clave de la asignatura

Presentación de la asignatura: En la primera sesión del curso se explican de forma detallada los contenidos de la asignatura, se plantea la metodología docente utilizada en las clases y se exponen los criterios de evaluación con nitidez.

Prácticas informáticas: A lo largo del curso se realizarán cuatro prácticas de informática que consistirán en la resolución de casos reales aplicando las técnicas y métodos estudiados en clase. Cada práctica tiene una primera parte docente, en la que se ayuda al estudiante a comprender los conceptos teóricos fundamentales, y en la segunda parte, se utilizan esos conceptos para resolver problemas.

Pruebas intermedias: Se realizarán tres pruebas intermedias que consistirán en resolver un problema real utilizando una hoja de cálculo. La primera prueba se realizará al finalizar el tema 3 del curso (mitad de noviembre); la segunda al acabar el tema 5 (mitad de diciembre) y la tercera al acabar el semestre.

Prueba global: De acuerdo al calendario establecido por el centro, en el periodo de exámenes, el estudiante realizará una prueba global que consistirá en un examen escrito donde se evaluarán las competencias y destrezas adquiridas con un peso del 70% y un examen práctico, mediante la resolución de un problema real con una hoja de cálculo, que tendrá un peso del 30%. Este examen práctico no será necesario para los alumnos que hayan superado las pruebas intermedias.

Inicio

Resultados de aprendizaje que definen la asignatura

El estudiante, para superar esta asignatura, deberá demostrar los siguientes resultados...

1:

1. Comprende y utiliza la probabilidad como una medida de incertidumbre de los fenómenos económicos.
2. Diferencia y aplica los modelos de probabilidad notables, tanto discretos como continuos.
3. Mide la incertidumbre de resultados y hechos futuros.
4. Emplea y planifica métodos de muestreo para extraer información de un fenómeno económico.
5. Calcula el tamaño muestral necesario para tomar decisiones con unas garantías.
6. Sintetiza la información muestral en los estadísticos usuales. Calcula y valora dichos estadísticos, enjuiciando sus conclusiones.
7. Infiere propiedades de los modelos teóricos a partir de las observaciones muestrales y justifica la bondad de dichas propiedades.
8. Diseña contrastes de hipótesis para corroborar o refutar una teoría a partir de la información muestral.
9. Emplea los contrastes más usuales para la proporción, la media y la varianza de un modelo aleatorio.

10. Compara y enjuicia las propiedades de dos modelos aleatorios, detectando las diferencias entre proporciones, medias y varianza.

Introducción

Breve presentación de la asignatura

La asignatura Estadística II es una asignatura asignada al Departamento de Estructura e Historia Económica y Economía Pública. Es una asignatura obligatoria de segundo curso. Tiene un marcado carácter cuantitativo, proporcionando las herramientas básicas para el tratamiento de la información y la cuantificación de los fenómenos económicos. Fundamenta el método estadístico para la toma de decisiones en el ámbito de la economía, detallando y justificando los métodos y técnicas para el análisis e interpretación de los datos económicos. La asignatura se centra principalmente en los métodos de inferencia, dotando al estudiante la capacidad de estimar y contrastar modelos que permiten describir y comprender los fenómenos económicos.

Contexto y competencias

Sentido, contexto, relevancia y objetivos generales de la asignatura

La asignatura y sus resultados previstos responden a los siguientes planteamientos y objetivos:

El planteamiento de la asignatura Estadística II es dotar al estudiante de las herramientas básicas para la comprensión y manejo de fenómenos aleatorios que están vinculados con el ámbito económico. Por lo tanto, tiene un perfil práctico para que pueda analizar, resolver e interpretar realidades económicas con el objetivo de realizar una toma de decisiones con rigor científico.

Los primeros temas están dedicados a los modelos aleatorios básicos y más utilizados para explicar fenómenos reales vinculados, principalmente, con variables económicas. Posteriormente, se presenta el carácter general de un problema económico donde el modelo teórico no es conocido totalmente y la investigación empírica es necesaria para su comprensión.

El siguiente tema aborda el problema de seleccionar una muestra que permita inferir los aspectos desconocidos del modelo propuesto. Se hace especial hincapié en el muestreo aleatorio que fundamenta los métodos inferenciales que se tratarán posteriormente. Un aspecto clave en este tema es el tamaño de la muestra para que nuestras conclusiones sean fiables y tengan ciertas garantías probabilísticas.

Los siguientes temas profundizan en los métodos inferenciales, tanto desde la perspectiva de la estimación de parámetros como de los contrastes de hipótesis. El estudiante descubrirá la diferencia de planteamientos y conclusiones, así como la interpretación de los resultados conseguidos. El último tema aborda la comparación de dos fenómenos, situación muy habitual cuando comparamos dos realidades económicas geográficas o temporales distintas o grupos diferentes.

Todos los contenidos de la asignatura tienen un objetivo práctico para que el estudiante tenga las herramientas y destrezas para aplicarlo en diferentes situaciones, obteniendo las conclusiones más relevantes y dando las interpretaciones necesarias para su comprensión.

Contexto y sentido de la asignatura en la titulación

La asignatura Estadística II pertenece al módulo de Entorno, Economía y Empresa del plan de estudios (Materia 5. Instrumentos), junto a la asignatura de Estadística I. Asimismo, es evidente que esta asignatura es la unión de los instrumentos analíticos del mismo módulo, tales como Matemáticas I, Matemáticas II y Análisis Económico.

Por un lado, utiliza los conocimientos y destrezas adquiridas en las asignaturas de Matemáticas I y II y la Estadística I, como una descripción resumida del fenómeno económico analizado y dota al estudiante de las técnicas y métodos para entender esa realidad e intentar explicarla a través de un modelo. En la asignatura se abordan por primera vez los procedimientos inferenciales, es decir, a partir de unos resultados observados intentar construir un modelo que se ajuste y explique dicho fenómeno económico. La asignatura de Análisis Económico abordará los mismos procedimientos a modelos más concretos y sofisticados, mostrando la aplicación del método científico a problemas económicos.

Al superar la asignatura, el estudiante será más competente para...

1:

Competencias Específicas:

- Participar en el asesoramiento a empresas, instituciones e inversores en la gestión y administración de los recursos financieros desde un enfoque integral
- Entender el funcionamiento de los mercados financieros, las instituciones que en ellos intervienen, los instrumentos que en ellos se negocian y su influencia en las decisiones de inversión y financiación de las organizaciones y personas.
- Identificar, interpretar y evaluar la información financiera y contable de las empresas e instituciones para identificar las fortalezas y debilidades, así como para asesorar desde un enfoque técnico, financiero y contable en la toma de decisiones.
- Desarrollar las funciones relativas a las áreas de análisis de inversiones, gestión financiera y de riesgos financieros, auditoria, contabilidad financiera y de costes y control presupuestario de las organizaciones.

Competencias Transversales:

- Capacidad de análisis y síntesis
- Capacidad para la resolución de problemas
- Capacidad para tomar de decisiones.
- Capacidad de razonamiento autónomo.
- Capacidad para utilizar medios tecnológicos en el ámbito del desempeño de la actividad
- Desarrollo de hábitos de autodisciplina, autoexigencia y rigor.

Importancia de los resultados de aprendizaje que se obtienen en la asignatura:

La asignatura tiene un doble objetivo para la formación del futuro profesional. Un primer interés viene dado por el carácter instrumental y cuantitativo de la asignatura que pretende dotar el estudiante de las herramientas básicas para extraer información y utilizar e interpretar dicha información para la comprensión de una realidad económica. Los métodos y técnicas aprendidas en esta asignatura permiten que el estudiante pueda desarrollar contenidos y aprendizajes en otras asignaturas de la titulación. Un segundo objetivo es la propia formación del estudiante con espíritu crítico frente a informes o proyectos del ámbito económico. Los métodos estadísticos, que permiten cuantificar y medir la incertidumbre de la información recogida, ayudan a garantizar unas conclusiones fiables y precisas para una toma de decisiones científica, dotando al estudiante de los criterios necesarios para entender y enjuiciar sus propios resultados o los proporcionados por otras fuentes.

Evaluación

Actividades de evaluación

El estudiante deberá demostrar que ha alcanzado los resultados de aprendizaje previstos mediante las siguientes actividades de evaluación

1:

La evaluación de la asignatura será global y basada en dos pruebas distintas. Una de ellas, de carácter práctico en ordenador, se podrá realizar bien de forma voluntaria durante el curso o bien en la prueba final.

Los estudiantes podrán realizar, de forma voluntaria, tres pruebas intermedias (P1, P2 y P3) de carácter práctico de resolución de una situación real mediante una hoja de cálculo en ordenador, cuyo peso será el 30% de la calificación final (un 10% cada prueba). Estas pruebas serán eliminatorias durante el periodo de clases y se compensarán si obtienen al menos un tres en cada una de ellas. Estas pruebas intermedias, se realizarán aproximadamente en las semanas 8^a, 12^a y 15^a del semestre.

Los estudiantes que no realicen estas pruebas durante el curso o tengan menos de tres puntos en alguna de ellas, realizarán una prueba práctica en ordenador que consistirá en la resolución de problemas reales mediante una hoja de cálculo y que tendrá un peso del 30% en la nota final. Dicha prueba se realizará en la fecha oficial indicada por la Comisión del Centro.

Finalmente, todos los alumnos deberán realizar un examen escrito (E) que consistirá en la resolución de problemas teóricos y prácticos que demuestre la adquisición de las competencias y destrezas de la asignatura, cuyo peso será del 70% de la nota. El examen escrito se realizará en la fecha oficial indicada por la Comisión del Centro.

Los alumnos que deban acudir a la segunda convocatoria realizarán las dos partes del examen global (el examen escrito de teoría y problemas, con una valoración del 70% y la prueba práctica en ordenador con una valoración del 30% de la nota final, respectivamente) el día señalado por la Comisión de Centro.

Criterios de valoración

El examen escrito (E) como las pruebas intermedias (P1, P2 y P3) serán puntuadas en una escala de 0 a 10. El estudiante debe tener al menos un 3 en cada una de ellas para poder realizar la media.

La nota final se calcularía como la media ponderada del 70% del examen escrito y el 30% de la media de las pruebas intermedias.

Nota final=

Actividades y recursos

Presentación metodológica general

El proceso de aprendizaje que se ha diseñado para esta asignatura se basa en lo siguiente:

Se utilizarán diferentes métodos docentes en el proceso de aprendizaje de la asignatura Estadística II en función de los objetivos marcados y las competencias desarrolladas. Así, se emplearán técnicas expositivas para las clases teóricas con el objetivo de analizar y desarrollar los conceptos fundamentales de la asignatura. Sin embargo, se emplearán formas didácticas de participación, implicando al estudiante, para desarrollar la capacidad de organizar, planificar y tomar decisiones.

Por otro lado, se utilizarán herramientas informáticas y resolución de casos para abordar las competencias de usar herramientas e instrumentos tecnológicos, resolución de problemas y habilidad para analizar y buscar información de otras fuentes. También, se realizarán clases de problemas en pizarra que permitan al estudiante desarrollar la capacidad de

adaptación a nuevas situaciones y de aplicar conocimientos en la práctica profesional.

Como apoyo se utilizará la plataforma Blackboard 9.1 donde se publicarán los materiales teóricos y prácticos de la asignatura, así como toda la información necesaria para su desarrollo comenzando por la propia guía docente. En concreto, hay materiales como mapas conceptuales de cada uno de los temas y videos tutoriales que serán de gran interés para los estudiantes para preparar y repasar la asignatura.

Actividades de aprendizaje programadas (Se incluye programa)

El programa que se ofrece al estudiante para ayudarle a lograr los resultados previstos comprende las siguientes actividades...

1:

Clases teóricas: Se emplearán para desarrollar principalmente los conceptos y desarrollos teóricos de cada uno de los temas. Se utilizarán técnicas expositivas pero motivando la participación y discusión en clase. El profesor se apoyará en una presentación y en el desarrollo del mapa conceptual correspondiente. Se recomienda la asistencia a clase, la participación y la toma de notas o aclaraciones a dicha presentación. El estudiante tendrá publicado con anterioridad tanto la presentación como el mapa conceptual y el desarrollo teórico que complementa la presentación.

Clases prácticas de problemas en pizarra: Esta actividad pretende mostrar al estudiante como abordar y resolver problemas. El profesor con antelación indicará los problemas que se abordará en cada sesión para que el estudiante pueda comprender e intentar resolverlo individualmente. De esta forma, la clase se pretende que sea participativa y los estudiantes puedan debatir y llegar a un acuerdo tanto en el análisis del problema como en su resolución final. Con este fin, el estudiante tendrá publicado con anterioridad la resolución de problemas tipo que le sirve de base para adaptarse a situaciones y contextos más complejos.

Clases prácticas de informática: Esta actividad se desarrollará en aulas de informática en equipos de dos personas, generalmente. El objetivo es resolver problemas más complejos y reales que en las prácticas de problemas. La clase tendrá una primera parte guiada por el profesor para conocer las técnicas básicas y, posteriormente, el estudiante tendrá que desarrollar el resto del trabajo hasta la resolución del problema. El estudiante tendrá publicado con anterioridad vídeos tutoriales que le preparen para la práctica y la plantilla de la práctica para agilizar la elaboración y la obtención de conclusiones.

Tutorías en grupo reducido: Se realizarán en el horario que el centro dispone unas series de horas de trabajo en grupo reducido para resolver dudas, realizar aclaraciones y supervisar el desarrollo de la asignatura. En esta actividad se pretende dar apoyo a los alumnos para que puedan tener las destrezas y capacidades necesarias para continuar el curso sin dificultad.

Planificación y calendario

Calendario de sesiones presenciales y presentación de trabajos

La asignatura consta de 6 créditos ECTS, lo que supone una carga de trabajo para el estudiante de 150 horas, entre presenciales y trabajo individual. Esta carga se reparte de la siguiente forma:

Actividades	Horas presenciales	Horas trabajo autónomo	Total carga estudiante
Clases teóricas (Grupo grande)	30	45	75
Prácticas de problemas (Dos subgrupos)	16	28	52
Prácticas de informática (Dos subgrupos)	8	8	16
Tutorías en grupo pequeño (Cuatro subgrupos)	3	3	6
Examen informático (Dos subgrupos)	6		6
Examen escrito	3		3
TOTAL	66	84	150

Esta carga docente se traduce en la siguiente planificación:

Fecha	Tema	Método Docente
1 ^a semana	Introducción, Guía Docente	Clase expositiva
	Tema 1	Clase expositiva
2 ^a semana	Tema 1	Clase expositiva
	Tema 1	Prácticas de problemas
3 ^a semana	Tema 2	Clase expositiva
	Tema 2	Prácticas de problemas
	Planteamiento del problema	Tutoría en grupo reducido
4 ^a semana	Tema 2	Clase expositiva
	Tema 2	Prácticas de problemas
5 ^a semana	Tema 3	Clase expositiva
	Temas 1 y 2	Prácticas de informática
6 ^a semana	Tema 3	Clase expositiva
	Tema 3	Prácticas de problemas
7 ^a semana	Tema 4	Clase expositiva
	Tema 3	Práctica de informática
8 ^a semana	Tema 4	Clase expositiva
	Prueba intermedia 1	Práctica de informática
	Caso sobre muestreo	Tutoría grupo reducido
9 ^a semana	Tema 5	Clase expositiva
	Tema 4	Prácticas de problemas
10 ^a semana	Tema 5	Clase expositiva
	Tema 5	Prácticas de problemas
11 ^a semana	Tema 6	Clase expositiva
	Temas 4 y 5	Práctica de informática
	Caso sobre estimación	Tutoría grupo reducido
12 ^a semana	Tema 6	Clase expositiva
	Prueba intermedia 2	Práctica de informática
13 ^a semana	Tema 6	Clase expositiva
	Tema 6	Práctica de problemas
14 ^a semana	Tema 7	Clase expositiva
	Tema 7	Práctica de problemas
15 ^a semana	Tema 7	Clase expositiva
	Temas 6 y 7	Práctica de informática
	Prueba intermedia 3	Práctica de informática
	Examen escrito	

Programa de la asignatura

BLOQUE I: CÁLCULO DE PROBABILIDADES

Tema 1: Variable aleatoria univariante discreta.

Concepto de variable aleatoria: discreta y continua: función de probabilidad. Distribuciones notables: Binomial, Hipergeométrica y Poisson.

Tema 2: Variable aleatoria univariante continua.

Concepto de variable aleatoria continua: función de densidad. Distribuciones notables: Uniforme y Exponencial.

Distribución NORMAL y sus relacionadas. INDEPENDENCIA de variables aleatorias.

BLOQUE II: TEORÍA DE MUESTRAS

Tema 3: Introducción a la Teoría de Muestras.

Conceptos básicos: población, muestra y estadístico. Tipos de muestreo. Distribución de un estadístico en el muestreo: método Monte Carlo y distribución límite. Determinación del tamaño muestral

BLOQUE III: TEORÍA DE LA ESTIMACIÓN

Tema 4: Estimación puntual.

Concepto de estimación. Métodos de construcción de estimadores: Método de los momentos, Método de máxima verosimilitud, Mínimos cuadrados. Propiedades de un estimador: insesgadez, consistencia y eficiencia.

Tema 5: Estimación por intervalo.

Concepto de intervalo de confianza. Método de construcción. Intervalos de confianza notables utilizando la distribución de los estadísticos usuales en el muestreo de poblaciones normales. Aplicaciones de interés.

BLOQUE IV: CONTRASTE DE HIPÓTESIS

Tema 6: Contraste de hipótesis paramétricas.

Conceptos básicos: hipótesis simples o compuestas, hipótesis nula y alternativa, nivel de significación y función de potencia. Contraste de máxima potencia: Lema de Neyman-Pearson. Contraste de la razón de verosimilitudes. Contrastos de hipótesis notables.

BLOQUE V: COMPARACIÓN DE DOS POBLACIONES

Tema 7: Comparación de dos poblaciones.

Tipo de información: muestras independientes y muestras apareadas.

Comparación de proporciones, medias y varianzas: Intervalos de confianza y contrastes de hipótesis.

Bibliografía

AGUARÓN, J.; ESCOBAR, M.T.; LASALA, P.; MIGUEL, J.A.; MORENO, J.M. y SALVADOR, M. (2001).*Problemas resueltos de Cálculo de Probabilidades para Economistas*. Colección Textos Docentes. Prensas Universitarias de Zaragoza.

CANAVOS, G. (1988). *Probabilidad y Estadística: aplicaciones y métodos*. McGraw-Hill.

CASAS, J.M. (1996). *Inferencia Estadística para Economía y Administración de Empresas*. Editorial Centro de Estudio Ramón Areces.

FERNÁNDEZ-ABASCAL, H. ET AL. (1995). *Ejercicios de Cálculo de Probabilidades: resueltos y comentados*. Ariel Matemática.

LIND, D.A.; MARCHAL, W.G. y WATHEN, S.A. (2008). *Estadística aplicada a los negocios y la economía*. Mc-Graw Hill

MANN, P.S. (2007) *Introductory Statistics*. Editorial Wiley..

MARTIN PLIEGO, F.J.; MONTERO, J.M. y RUIZ-MAYA, L. (2005). *Problemas e Inferencia Estadística. 3ª Edición*. Editorial AC.

MURGUI, S. y otros (1992). *Estadística para economía y administración de empresas. Aplicaciones y ejercicios*. Editorial Puchades.

NEWBOLD, P. (1997). *Estadística para los negocios y la Economía. 4ª Edición*. Prentice Hall.

NEWBOLD, P.; CARLSON, W. y THORNE, B. (2008). *Estadística para Administración y Economía. 6ª Edición*. Prentice Hall.

PARRA FRUTOS, I. (2003). *Problemas de Inferencia Estadística. Estadística Empresarial con Microsoft Excel*. Editorial Thomson.

PEÑA, D. (2005) *Fundamentos de Estadística*. Ciencias Sociales Alianza Editorial.

PEÑA, D. y ROMO, J. (1997). *Introducción a la Estadística para las Ciencias Sociales*. McGraw-Hill.

PÉREZ, C. (2001). *Estadística Aplicada a través de Excel*. Prentice Hall.

PÉREZ, R. y LÓPEZ, A.J. (1997). *Análisis de datos económicos II: Métodos Inferenciales*. Editorial Pirámide.

UÑA JUÁREZ, I.; TOMEÓ PERUCHA, V. y SAN MARTÍN MORENO, J. (2003). *Lecciones de Cálculo de Probabilidades. Curso teórico-práctico*. Editorial Thomson.

Referencias bibliográficas de la bibliografía recomendada

- Canavos, George C.. Probabilidad y estadística : aplicaciones y métodos / George C. Canavos . - 1^a ed. en español, [reimp.] Madrid [etc.] : McGraw-Hill, D. L. 2003
- Casas Sánchez, José Miguel. Inferencia estadística para economía y administración de empresas / José M. Casas Sánchez Madrid : Centro de Estudios Ramón Areces, D.L. 1996
- Ejercicios de cálculo de probabilidades : resueltos y comentados / H. Fernández-Abascal... [et al.] . - 1a. ed. Barcelona : Ariel, 1995
- Estadística para economía y administración de empresas : aplicaciones y ejercicios / [J. Santiago Murgui Izquierdo... et al.] . - [1a. ed.] Valencia : G. Puchades, 1992
- Lind, Douglas A.. Estadística aplicada a los negocios y la economía / Douglas A. Lind, William G. Marchal, Samuel A. Wathen ; revisión técnica, Ofelia Vizcaíno Díaz ... [et al.] . - 13^a ed. México D.F. : McGraw-Hill/Interamericana, [2008]
- Mann, Prem S.. *Introductory statistics* / Prem S. Mann . - 6th ed. Hoboken, NJ : John Wiley & Sons, cop. 2007
- Martín Pliego, Francisco Javier. Problemas de inferencia estadística / F.J. Martín Pliego, J. M^a. Montero Lorenzo, L. Ruiz-Maya Pérez . - 3^a ed. Madrid : Thomson, D.L. 2005
- Newbold, Paul. Estadística para administración y economía / Paul Newbold , William L. Carlson, Betty M. Thorne ; traducción, Esther Rabasco Espáriz ; revisión técnica, Luis Toharia . - 6^a ed. Madrid : Pearson Educación, cop. 2008
- Newbold, Paul. Estadística para los negocios y la economía / Paul Newbold ; traducción, Macarena Estévez Muñoz... [et al.] ; revisión técnica, Alberto Maydeu Olivares . - [1a. ed. en español, de la 4a. ed. en inglés] Madrid [etc.] : Prentice Hall, 1997
- Parra Frutos, Isabel. Estadística empresarial con Microsoft Excel : Problemas de inferencia estadística / Isabel Parra Frutos . - 2a. ed. Madrid : Editorial AC; Thomson, 2003
- Peña Sánchez de Rivera, Daniel. Fundamentos de estadística / Daniel Peña Madrid : Alianza, D.L. 2008
- Peña Sánchez de Rivera, Daniel. Introducción a la estadística para las ciencias sociales / Daniel Peña, Juan Romo Madrid : Mc Graw-Hill, D. L. 2003
- Pérez López, César. Estadística aplicada a través de Excel / César Pérez López . - Reimp. Madrid [etc.] : Prentice Hall, 2008
- Pérez Suárez, Rigoberto. Análisis de datos económicos II. Vol. 2, Métodos inferenciales / Rigoberto Pérez Suárez, Ana Jesús López Menéndez Madrid : Pirámide, D. L. 1997
- Problemas resueltos de cálculo de probabilidades para economistas / Juan Aguarón... [et al.] . - 1a. ed. Zaragoza : Prensas Universitarias de Zaragoza, 2001
- Uña Juárez, Isaías. Lecciones de cálculo de probabilidades : curso teórico- práctico / Isaías Uña Juárez, Venancio Tomeo Perucha, Jesús San Martín Moreno Madrid [etc.] : Thomson, D.L. 2003
- Yuste, Rafael. Trilogía de historia natural / Rafael Yuste Zaragoza : Prensas Universitarias de Zaragoza, 2001