

Plan 245 Lic.Admon.y Dirección de Empresas

Asignatura 43671 COMPLEMENTOS DE ECONOMETRIA

Grupo 1

Presentación

Complementos al Modelo de Regresión Múltiple y al Modelo de Ecuaciones Simultáneas. Modelos para el análisis de datos microeconómicos. Utilización de paquetes econométricos para ordenadores.

Programa Básico

Objetivos

Al finalizar el curso el alumno debe ser capaz de:

Comprender los elementos básicos que caracterizan un modelo dinámico.

Conocer la teoría asintótica que justifica el tratamiento de los modelos con regresores estocásticos.

Comprender el problema de las relaciones espurias en economía y abordar el trabajo econométrico con variables no estacionarias.

Analizar y estimar adecuadamente un Modelo de ecuaciones aparentemente no relacionadas (SUR).

Comprender los elementos que caracterizan los Modelos de elección discreta o variable dependiente cualitativa.

Conocer y manejar los procedimientos del programa informático Eviews para aplicarlos en el contexto de los modelos anteriores.

Interpretar de forma crítica los resultados obtenidos.

Programa de Teoría

Los ejercicios prácticos corresponderán a los temas incluidos en el programa de teoría y se realizarán mediante el programa informático EViews.

Programa Práctico

Evaluación

Alcaide, A. y otros (2001): "Aplicaciones Econométricas" UNED, Madrid.

Álvarez, N. ((2001): "Econometría II: Análisis de modelos econométricos de series temporales" AC, Madrid.

Andrés, J., Escribano, A., Molinas, C. y Taguas, D.: "La inversión en España. Econometría con restricciones de equilibrio" Antoni Bosch editor. Instituto de Estudios Fiscales. Barcelona, 1990.

Aznar, A. y F.J. Trívez. " Métodos de Predicción en Economía II. Análisis de Series Temporales" Ed. Ariel Economía.

Banerjee, A., Dolado, J., Galbraith, J. y Hendry, D.: "Co-Integration, Error-Correction, and the Econometric Analysis of Non-Stationary Data" Oxford University Press, New York, 1994.

Caridad , J. M.: " Econometría: Modelos Econométricos y Series Temporales con los paquetes microTSP y TSP. Tomo 2: Modelos Econométricos Multiecuacionales, Predicción Económica y Series Temporales ". Ed. Reverté. Barcelona, 1998.

Carrascal, U., González, Y. y Rodríguez, B. (2000): Análisis Econométrico con Eviews. Ed. Rama

Cuadernos Económicos de ICE, Nº 44, 1990/1: "Cointegración y raíces unitarias: Un área en crecimiento" (coordinado por Álvaro Escribano).

Davidson, R. y Mackinnon, J. G. (1993): "Estimation and Inference in Econometrics". Oxford University Press, New York.

Greene, W. H.: " Análisis Econométrico". Prentice Hall. Madrid, 1999.

Hendry, D.: "The Structure of Simultaneous Equations Estimators". Journal of Econometrics. 1976.

Schmidt, P.: "Econometrics". Marcel Dekker. New York, 1976.

Johnston, J.: "Métodos de Econometría". Vicens-Vives. Barcelona, 1989.

Johnston, J. y Dinardo, J. (2001): "Métodos de Econometría" Vicens Vives.

Novalés, A: "Econometría". Mc Graw Hill. Madrid, 1993.

Otero, J.: "Econometría. Series temporales y predicción" AC, 1993.

Pena, B. y otros (1999). Cien Ejercicios de Econometría. Ed. Pirámide

Pindyck, R. S. And Rubinfeld, D. L.: "Econometría. Modelos y pronósticos". McGraw-Hill, Madrid, 2001.

Ramanathan, R. (1998): "Introductory Econometrics with Applications" Dryden Press, USA.

Sánchez, C.: "Métodos Econométricos". Ariel. Barcelona, 1999.

Theil, H.: "Principles of Econometrics". Wiley. New York, 1971.

Wooldridge, J. (2001): "Introducción a la Econometría. Un enfoque moderno". Paraninfo Thomson Learning, Madrid.

BIBLIOGRAFÍA REDUCIDA

Teoría:

Davidson, R. y Mackinnon, J. G. (1993): "Estimation and Inference in Econometrics". Oxford University Press, New York.

Greene, W. H. (1999): " Análisis Econométrico". Prentice Hall. Madrid.

Johnston, J. y Dinardo, J. (2001): "Métodos de Econometría" Vicens Vives.

Novalés, A (1993): "Econometría". Mc Graw Hill. Madrid.

Pindyck, R. S. And Rubinfeld, D. L. (2001): "Econometría. Modelos y pronósticos". McGraw-Hill, Madrid.

Wooldridge, J. (2001): "Introducción a la Econometría. Un enfoque moderno". Paraninfo Thomson Learning, Madrid.

Práctica

Alcaide, A. y otros (2001): "Aplicaciones Econométricas" UNED, Madrid.

Caridad, J. M. (1998): " Econometría: Modelos Econométricos y Series Temporales con los paquetes microTSP y TSP. Tomo 2: Modelos Econométricos Multiecuacionales, Predicción Económica y Series Temporales ". Ed. Reverté. Barcelona.

Carrascal, U., González, Y. y Rodríguez, B. (2000): Análisis Econométrico con Eviews. Ed. Rama

Pena, B. y otros (1999). Cien Ejercicios de Econometría. Ed. Pirámide

Pindyck, R. S. And Rubinfeld, D. L. (2001): "Econometría. Modelos y pronósticos". McGraw-Hill, Madrid.

Ramanathan, R. (1998): "Introductory Econometrics with Applications" Dryden Press, USA.

Wooldridge, J. (2001): "Introducción a la Econometría. Un enfoque moderno". Paraninfo Thomson Learning, Madrid.

Bibliografía

True
