

Plan 245 Lic.Admon.y Dirección de Empresas

Asignatura 43644 ECONOMETRIA

Grupo 1

### Presentación

Modelo de regresión múltiple: validez de las estimaciones y formación dinámica. Modelo de ecuaciones simultáneas.

### Programa Básico

- Tema 1: El modelo de regresión lineal clásico I
- Tema 2: El modelo de regresión lineal clásico II
- Tema 3: Predicción
- Tema 4: Variables ficticias
- Tema 5: Errores de especificación
- Tema 6: Multicolinealidad
- Tema 7: Modelo de regresión lineal generalizado
- Tema 8: Heteroscedasticidad
- Tema 9: Autocorrelación
- Tema 10: Regresores estocásticos
- Tema 11: Modelos dinámicos
- Tema 12: Introducción a los modelos de ecuaciones simultáneas

### Objetivos

Se pretende que el alumno al finalizar el curso sea capaz de:

- Conocer el papel de la Econometría en la Economía.
- Conocer los elementos básicos para especificar, contrastar y predecir en un modelo de regresión múltiple.
- Adquirir las habilidades básicas para el desarrollo de la Econometría teórica en el contexto de un modelo de regresión múltiple.
- Aplicar los procedimientos teóricos a situaciones prácticas, al mismo tiempo que interpretar de forma crítica los resultados obtenidos.
- Conocer y aplicar los procedimientos del programa informático Eviews para estimar, contrastar y predecir en un modelo de regresión múltiple.

### Programa de Teoría

- Tema 1.- El modelo de regresión lineal clásico I
- Tema 2.- El modelo de regresión lineal clásico II
- Tema 3.- Predicción
- Tema 4.- Variables ficticias
- Tema 5.- Errores de especificación
- Tema 6.- Multicolinealidad.
- Tema 7.- Modelo de regresión lineal generalizado
- Tema 8.- Heteroscedasticidad
- Tema 9.- Autocorrelación
- Tema 10.- Regresores estocásticos

Tema 11.- Modelos dinámicos

Tema 12.- Introducción a los modelos de ecuaciones simultáneas

---

## Programa Práctico

A lo largo del curso se efectuarán varias sesiones prácticas en las Salas de informática de la Facultad. Allí se aplicarán los contenidos teóricos explicados mediante el paquete econométrico Eviews.

En este curso 2006-2007 las prácticas se distribuirán en distintos bloques :

- Bloque 1: contiene las prácticas relativas a los temas 1, 2 y 3 del programa
- Bloque 2: contiene las prácticas relativas a los temas 4, 5 y 6 del programa
- Bloque 3: contiene las prácticas relativas a los temas 7 y 8 del programa
- Bloque 4: contiene las prácticas relativas al tema 9 del programa
- Bloque 5: contiene las prácticas relativas a los temas 10 y 11 del programa
- Bloque 6: contiene las prácticas relativas al tema 12 del programa
- Bloque 7: contiene las prácticas relativas a los exámenes del año anterior

---

## Evaluación

Las pruebas y los criterios para la evaluación de los conocimientos adquiridos por los alumnos a lo largo del curso, dentro de esta asignatura, podrán ser alguno de los siguientes:

1. Dos exámenes parciales: cada uno constará de dos partes, una teórica y otra práctica. Para aprobar cada parcial, es necesario tener, al menos, un 30% de la puntuación de cada una de las partes. El alumno superará la asignatura si obtiene una puntuación mayor o igual a 5 en cada uno de estos parciales.
2. Un examen final: Tanto en la convocatoria ordinaria (junio) como en la extraordinaria (septiembre), el examen constará de dos partes, una teórica y otra práctica. Para aprobar este examen, es necesario tener, al menos, un 30% de la puntuación de cada una de las partes.

En ambos casos la parte práctica consistirá en la realización de un ejercicio práctico con ayuda de ordenador.

Los exámenes serán desarrollados por escrito, salvo en el caso de los alumnos que hayan realizado previamente algún ejercicio de evaluación de forma fraudulenta. En estos casos, se actuará de acuerdo con lo establecido en el Reglamento de Ordenación Académica de la Universidad y en el Decreto de 8 de septiembre de 1954 (BOE de 12 de octubre), parcialmente derogado, por el que se aprueba el Reglamento de Disciplina académica.

Las fechas previstas para la realización de los exámenes durante el curso académico 2005-2006 son las siguientes:

- \* el día 6 de febrero de 2007 se efectuará el examen del primer parcial
- \* el día 28 de junio de 2007 se realizará el examen final de la Convocatoria Ordinaria. Aquellos alumnos que hayan superado el examen parcial sólo deberán realizar el examen correspondiente al segundo parcial.
- \* el día 14 de septiembre de 2007 para la Convocatoria Extraordinaria

---

## Bibliografía

### TEORÍA

ALONSO, A. (2004). "Econometría". Ed. Pearson.

GUJARATI, D. (1990). "Econometría". Ed McGraw-Hill. 2ª Edición. Bogota

JOHNSTON, J. y DINARDO, J.(2001). "Métodos de Econometría". Vicens-Vives.

NOVALES, A. (1993). "Econometría". Ed. McGraw-Hill

### PRÁCTICAS

---

---

ALEGRE, J. y otros (1995), "Ejercicios y Problemas de Econometría". Ed. AC.

CARRASCAL ARRANZ, U. y otros (2000), "Análisis Económico con Eviews". Ed. Ra-Ma.

FERNÁNDEZ SÁINZ, A. y otros. (1995), "Ejercicios de Econometría". Ed. McGraw-Hill.

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

URIEL JIMÉNEZ, E. y otros (1990), "Econometría. El modelo lineal". Ed. AC.

---