

Plan 246 Lic. en Economía
 Asignatura 43701 ECONOMETRIA
 Grupo 1

Presentación

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

Programa Básico

1. DESCRIPTOR DE LA ASIGNATURA

Modelo de regresión múltiple; validez de las estimaciones y su formulación dinámica. Modelo de ecuaciones simultáneas.

2. PROGRAMA DE ECONOMETRÍA

- 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: Análisis de regresión con series temporales. Autocorrelación
- Tema 10: Análisis Univariante de Series temporales

Objetivos

Se pretende que el alumno conozca el papel de la Econometría en la Economía, los elementos básicos para especificar, contrastar y predecir un modelo de regresión múltiple.

Que adquiera las habilidades básicas para el desarrollo de la Econometría teórica en el contexto de un modelo de regresión múltiple.

Que sea capaz de aplicar los procedimientos teóricos a situaciones prácticas, al mismo tiempo que interpretar de forma crítica los resultados obtenidos.

Que conozca y aplique 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 I

Programa Práctico

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

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 a los temas 9 y 10 del programa
- Bloque 5: 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 con ayuda de ordenador.

Las fechas previstas para la realización de los exámenes durante el curso académico 2006-2007 son las siguientes:

- El día 9 de febrero de 2007 se efectuará el examen del primer parcial
- El día 8 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 13 de septiembre de 2007 para la Convocatoria Extraordinaria

Bibliografía

TEORÍA

- ALONSO, A. (2004). "Econometría". Ed. Pearson.
- GUJARATI, D. (2003). "Econometría". Ed McGraw-Hill. 4ª Edición.
- 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.

