

Plan 248 Lic.CC.Actuariales y Financieras

Asignatura 43616 ECONOMETRIA ACTUARIAL

Grupo 1

Presentación

Programa Básico

1. DESCRIPTOR DE LA ASIGNATURA

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

2. OBJETIVOS DOCENTES Y CONOCIMIENTOS A ADQUIRIR

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.

3. CONOCIMIENTOS PREVIOS RECOMENDADOS

No existen conocimientos previos exigibles. No obstante, se recomienda tener conocimientos de probabilidad e inferencia y álgebra matricial.

4. MATERIAL DIDÁCTICO PARA EL ESTUDIO DE LA ASIGNATURA

Los temas que integran el Programa pueden prepararse por cualquiera de los manuales de Econometría al uso, que aparecen recogidos en la bibliografía.

5. CRITERIOS DE EVALUACIÓN: EXÁMENES Y TRABAJOS

Los alumnos deberán demostrar el conocimiento del programa propuesto a través de las diferentes pruebas que se realicen a lo largo del curso, tanto teóricas como prácticas.

Asimismo se efectuará un examen final tanto en la convocatoria ordinaria (junio), como en la extraordinaria (septiembre) que constará de dos partes, una teórica y otra práctica. Para superar el examen será necesario tener al menos un 30 por 100 de la puntuación de cada una de las partes.

6. PROGRAMA Y BIBLIOGRAFÍA

6.1. Programa de Econometría

Tema 1. Introducción

Tema 2. Modelo de regresión (i)

Tema 3. Modelo de regresión (ii)

Tema 4. Métodos de los mínimos cuadrados generalizados

Tema 5. Introducción a los modelos arima

Tema 6. Introducción a los modelos de variable dependiente cualitativa

Tema 7. Otros temas de Econometría

6.2. Programa de Prácticas

El 50% de la docencia de esta asignatura se realiza en las salas de informática con el programa econométrico Eviews.

6.3. Bibliografía

Teoría:

- ALONSO A., y otros (2004). "Econometría". Ed. Pearson. Madrid

- AZNAR, A. y TRIVEZ, F.J. (1993): "Métodos de Predicción en Econometría II". Análisis de Series Temporales. E. Ariel Economía.
- GREENE W.(1998). "Análisis Econométrico" (edic. 3ª). Ed. Prentice Hall.
- GUJARATI, D. (2003)."Econometría". Ed McGraw-Hill. 4ª Edición
- GUILLÉN, M.; AYUSO, M.; CARRILLO, M.: "Econometría Actuarial: Material docent i casos pràctics". Departament d'í Econometría, Estadística i Economía Espayola. Universitat de Barcelona, 1996.
- GUISÁN SEIJAS, C. (1986): "Fundamentos de Econometría". Santiago de Compostela.
- JOHNSTON, J. y DINARDO, J.(2001). "Métodos de Econometría". Vicens-Vives.
- MADDALA, G.S. (1996). "Introducción a la Econometría". Ed.McGraw-Hill.
- MARTIN,G., y otros (1997). "Introducción a la Econometría". Ed.Prentice Hall.
- NOVALES, A. (1993). "Econometría". Ed. McGraw-Hill
- OTERO, J. M.^a (1993): "Econometría". Series temporales y predicción". Ed. AC.
- PINDYCK R. y RUBINFELD, D.L. (2000). "Econometría: modelos y pronósticos". Ed. MacGraw-Hill.
- PULIDO, A. (2001). "Modelos Econométricos". Ed.Pirámide.
- PULIDO, A. y LÓPEZ, A. (199): "Predicción y simulación aplicada a la economía y gestión de empresas". Ed. Pirámide.
- URIEL, E. y otros (1990). "Econometría. El modelo lineal". Ed. AC.
- WOOLDRIDGE, J. (2001). "Introducción a la Econometría". Ed. Thomson Learning.

Práctica:

- ALEGRE, J. y otros (1995), "Ejercicios y Problemas de Econometría". Ed. AC.
- CARRASCAL ARRANZ, U. y otros (2000), "Análisis Econométrico 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, E. y otros (1990), "Econometría. El modelo lineal". Ed. AC.

Objetivos

En esta asignatura el objetivo es presentar modelos y métodos econométricos que tienen una aplicación directa sobre las magnitudes económicas del sector asegurador. La primera parte del curso se dedica al estudio del modelo de regresión, introduciendo al alumno en la utilización de los paquetes informáticos de econometría de uso más frecuente. En la segunda parte se estudian los problemas econométricos más característicos de las Ciencias Actuariales y Financieras efectuando una introducción a los métodos econométricos más avanzados.

Programa de Teoría

Tema 1. Introducción Tema 2. Modelo de regresión (i) Tema 3. Modelo de regresión (ii) Tema 4. Métodos de los mínimos cuadrados generalizados Tema 5. Introducción a los modelos arima Tema 6. Introducción a los modelos de variable dependiente cualitativa Tema 7. Otros temas de econometría

Programa Práctico

El 50% de la docencia de esta asignatura se realiza en las salas de informática con el programa econométrico Eviews.

Evaluación

Los alumnos deberán demostrar el conocimiento del programa propuesto a través de las diferentes pruebas que se realicen a lo largo del curso, tanto teóricas como prácticas. Asimismo se efectuará un examen final en la convocatoria ordinaria (junio), como en la extraordinaria (septiembre) que constará de dos partes, una teórica y otra práctica. Para superar el examen será necesario tener al menos un 30 por 100 de la puntuación de cada una de las partes.

Bibliografía

AZNAR, A. y TRIVEZ, F.J. (1993): "Métodos de Predicción en Econometría II". Análisis de Series Temporales. E. Ariel Economía. * GREENE, V. (1998). "Análisis Econométricos" (edic. 3ª). Ed. Prentice Hall. * GUILLÉN, M.; AYUSO, M.; CARRILLO, M.: "Econometría Actuarial: Material docent i casos pràctics". Departament d'í Econometría, Estadística i Economía Espayola. Universitat de Barcelona, 1996. * GUISÁN SEIJAS, C. (1986): "Fundamentos de Econometría". Santiago de Compostela. * JOHNSTON, J. (1987): "Métodos de Econometría". Vicens-Vives. * MADDALA, G.S. (1996): "Introducción a la Econometría". Ed. McGraw-Hill. * NOVADES, A. (1993): "Econometría". Ed. McGraw-Hill. * OTERO, J. M.^a (1993): "Econometría". Series temporales y predicción". Ed. AC. * PENA, T. y otros (1999): "Cien ejercicios de Econometría". Ed. Pirámide. * PULIDO, A. (1983): "Modelos Econometricos". Ed. Pirámide. * PULIDO, A. y LÓPEZ, A. (199): "Predicción y simulación aplicada a la economía y gestión de empresas". Ed. Pirámide.