

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: Heteroscedasticidad
- Tema 8: Autocorrelación
- Tema 9: Regresores estocásticos
- Tema 10: Modelos dinámicos
- Tema 11: Introducción a los modelos de ecuaciones simultáneas

### Objetivos

Se pretende que el alumno conozca el papel de la Econometría en la economía, los elementos básicos para especificar, contrastar y predecir en 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.

Todos estos aspectos serán abordados en los doce temas que se desarrollarán a lo largo del curso y cuya estructura se recoge en el Desglose del Programa que presentamos.

### 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.- Heteroscedasticidad
- Tema 8.- Autocorrelación

- 
- Tema 9.- Regresores estocásticos
- Tema 10.- Modelos dinámicos
- Tema 11.- 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, mediante el paquete econométrico Eviews, los contenidos teóricos explicados.

En este curso 2011-12 las prácticas se distribuirán en distintos bloques:

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

## 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) para aquellos alumnos que no hayan aprobado por parciales, como en la extraordinaria (julio), 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.

Para determinar la calificación final, además de la nota obtenida en el examen, se podrá valorar la participación de los estudiantes durante el curso en las distintas actividades propuestas.

Las fechas previstas para la realización de los exámenes durante el curso académico 2011-12 son las siguientes:

- El día 27 de enero de 2012 se efectuará el examen del primer parcial.
  - El día 19 de junio de 2012 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 19 de julio de 2012 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 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 JIMÉNEZ, E. y otros (1990), "Econometría. El modelo lineal". Ed. AC.

---

## 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: Heteroscedasticidad
- Tema 8: Autocorrelación
- Tema 9: Regresores estocásticos
- Tema 10: Modelos dinámicos
- Tema 11: Introducción a los modelos de ecuaciones simultáneas

## Objetivos

Se pretende que el alumno conozca el papel de la Econometría en la economía, los elementos básicos para especificar, contrastar y predecir en 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.

Todos estos aspectos serán abordados en los doce temas que se desarrollarán a lo largo del curso y cuya estructura se recoge en el Desglose del Programa que presentamos.

## 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. - Heteroscedasticidad
- Tema 8.- Autocorrelación
- Tema 9.- Regresores estocásticos
- Tema 10.- Modelos dinámicos

## 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 2010-11 las prácticas se distribuirán en distintos bloques:

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

## 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) para aquellos alumnos que no hayan aprobado por parciales, como en la extraordinaria (julio), 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.

Para determinar la calificación final, además de la nota obtenida en el examen, se podrá valorar la participación de los estudiantes durante el curso en las distintas actividades propuestas.

Las fechas previstas para la realización de los exámenes durante el curso académico 2010-11 son las siguientes:

- El día 17 de enero de 2011 se efectuará el examen del primer parcial.
- El día 31 de mayo de 2011 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 12 de julio de 2011 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 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 JIMÉNEZ, E. y otros (1990), "Econometría. El modelo lineal". Ed. AC.

