

GUÍA DOCENTE	2012/13
Centro	321 - Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales
Plan	GECONO30 - Grado en Economía
ASIGNATURA	
Econometría Aplicada	Créditos ECTS : 6
COMPETENCIAS/DESCRIPCION/OBJETIVOS	
<p>DESCRIPTORES Situaciones de incumplimiento de los supuestos básicos del Modelo de Regresión Lineal General. Modelo de regresión lineal generalizado. Modelos de regresión dinámicos.</p> <p>Objetivos:</p> <p>Este curso es una continuación de Introducción a la Econometría. En él se analizan los distintos problemas que surgen a la hora de especificar y estimar un modelo econométrico derivados de la violación de alguno de los supuestos básicos del MLRG: heterocedasticidad, autocorrelación, regresores estocásticos y modelos dinámicos. Se proponen distintos contrastes para la detección de estos problemas y se estudian en cada caso métodos de estimación más adecuados, alternativos al de Mínimos Cuadrados Ordinarios.</p> <p>Competencias específicas:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Comprender el significado y relevancia de cada uno de los supuestos empleados en la especificación de un modelo econométrico para emplear supuestos realistas de acuerdo a las circunstancias del fenómeno económico que se desea analizar. 2. Diferenciar entre distintos métodos de estimación para usar el más adecuado de acuerdo a las características de las variables económicas bajo estudio. 3. Identificar las fuentes estadísticas pertinentes a fin de ser capaz de buscar y organizar de manera sistemática los datos económicos disponibles relevantes para explicar un cierto fenómeno económico. 4. Utilizar con soltura software econométrico para analizar relaciones entre variables económicas. 5. Interpretar adecuadamente los resultados obtenidos con el fin de elaborar informes significativos y coherentes sobre el comportamiento de los datos económicos. <p>Competencias transversales :</p> <p>&#8226; Saber buscar, analizar y sintetizar información proveniente de diversas fuentes con capacidad crítica, autocrítica y de aprendizaje autónomo, para emitir juicios razonados sobre temas relevantes de índole económica, social o científica (G004 DEL GRADO).</p> <p>&#8226; Elaborar informes y transmitir ideas sobre cualquier materia económica, con claridad y coherencia, a un público tanto especializado como no especializado, haciendo uso de la competencia idiomática requerida en cada caso (G006 DEL GRADO).</p> <p>&#8226; Saber integrarse en grupos de trabajo multidisciplinares, desarrollando las habilidades requeridas para cada situación: trabajo en equipo, liderazgo, iniciativa, creatividad, o toma de decisiones (G005 DEL GRADO).</p>	
TEMARIO	
<ol style="list-style-type: none"> 1. Generalización del Modelo de Regresión Lineal. Repaso de conceptos básicos y teoría asintótica. Modelo de regresión con perturbaciones no esféricas. Propiedades de los estimadores de MCO. Método de Mínimos Cuadrados Generalizados (MCG). Método de Mínimos Cuadrados Generalizados Factibles (MCGF). 2. Heterocedasticidad. Especificación y causas. Estructuras de heterocedasticidad. Contrastos de heterocedasticidad. MCG o MCP: Mínimos Cuadrados Generalizados o Ponderados. MCGF: Especificación de un modelo para la heterocedasticidad. MCO: Estimador robusto de la matriz de varianzas y covarianzas. 3. Autocorrelación. Especificación y causas. Estructuras de autocorrelación. Contrastos de autocorrelación. MCG: Mínimos Cuadrados 	

Generalizados. MCGF: Mínimos Cuadrados Generalizados Factibles: Método de Cochrane-Orcutt. MCO: Estimador robusto de la matriz de varianzas y covarianzas.

4. Regresores Estocásticos y Modelos Dinámicos.

Errores en variables y variables latentes: Propiedades del estimador MCO. Variable endógena retardada: Propiedades del estimador MCO. Método de Variables Instrumentales (VI). Contraste de Hausman. Modelos con retardos de variables exógenas.

TIPOS DE DOCENCIA

Tipo de Docencia	M	S	GA	GL	GO	GCL	TA	TI	GCA
Horas de Docencia Presencial	42	9	9						
Horas de Actividad No Presencial del Alumno	60	18	12						

Leyenda: M: Magistral S: Seminario GA: P. de Aula GL: P. Laboratorio GO: P. Ordenador
GCL: P. Clínicas TA: Taller TI: Taller Ind. GCA: P. de Campo

Aclaraciones :

La metodología docente se basará en tres tipos de sesiones lectivas: clases magistrales en las que se desarrollarán los distintos temas del programa del curso, explicando los conceptos e ilustrándolos con ejemplos, clases prácticas donde se realizarán ejercicios y problemas para afianzar los conceptos del curso y seminarios.

Plataforma de apoyo a la docencia: Existe un curso virtual de apoyo a la asignatura creado con la plataforma de apoyo docente Moodle. En él se encuentran a disposición de los alumnos los materiales didácticos utilizados a lo largo del curso. Material didáctico: Diapositivas, notas de clase y documentos a disposición del alumno en la página web de la asignatura.

Trabajo escritos: Los ejercicios prácticos serán proporcionados y discutidos en las clases. Los estudiantes pueden ser requeridos a entregar respuestas escritas a problemas tanto directamente como a través de la plataforma virtual de apoyo docente. Igualmente, se podrá valorar la participación en la realización de un trabajo en grupo.

EVALUACION

- Examen escrito a desarrollar
- Realización de prácticas (ejercicios, casos o problemas)
- Trabajos individuales
- Trabajos en grupo
- Exposición de trabajos, lecturas...

Aclaraciones :

Las competencias serán evaluadas mediante un proceso de evaluación continua y la calificación final será obtenida de la forma siguiente:

• Examen escrito: 60% ;
• Ejecución y presentación de ejercicios individuales y/o en grupo: 40%.

Los alumnos que no sigan la evaluación serán evaluados mediante una prueba final que valore todas las competencias de la asignatura.

MATERIALES DE USO OBLIGATORIO

BIBLIOGRAFIA

Bibliografía básica

- Alonso, Fernández y Gallastegui (2004), Econometría, Prentice-Hall (Pearson); ISBN: 84-205-4460-4.
Gujarati, D. (2010), Econometría, ed. McGraw-Hill, 5^a edición.
Ramanathan, R. (2002), Introductory Econometrics with applications, South-Western, 5th edition.
• Wooldridge, J.M. (2003), Introductory Econometrics: A modern Approach, South-Western, 2nd edition.

Ejercicios:

•Alonso, A., Fernández, J., Gallastegui, I., (2004), *Econometría, Appendices*, Prentice-Hall (Pearson).
•Fernández, A., González, P., Regúlez, M., Moral, P., Esteban, V. (2005), *Ejercicios de Econometría*, ed. McGraw-Hill, 2^a edición.
•Alegre, J., Arcarons, J., Bolancé, C. y Díaz, L. (1995), *Ejercicios y Problemas de Econometría*, Colección Plan Nuevo, ediciones AC.
•Ramanathan, R. (2002) *Instructor's Manual to accompany*, del libro *Introductory Econometrics with applications*, ed. South-Western, 5th edition, Harcourt College Publishers.
•Wooldridge, J.M. (2003), *Student Solutions Manual*, del libro *Introductory Econometrics: A modern Approach*, ed. South-Western, 2nd edition.
•Recopilación de ejercicios recomendados y exámenes de Econometría. Departamento de Economía Aplicada III (Econometría y Estadística). Disponible en Lankopi y/o Moodle.

Bibliografía de profundización

•Greene, W. (1998), *Análisis Econométrico*, ed. Prentice Hall, 3^a edition.
•Johnston, J. (1983), *Métodos de Econometría*, ed. Vicens Vives, 4^a edición.
•Maddala (1996), *Introducción a la Econometría*, ed. Pearson: Prentice Hall.
•Novales, A. (1993), *Econometría*, ed. McGraw-Hill, 2^a edición.
•Pindyck, R.S. y Rubinfeld, D.L. (1998), *Econometric Models and Economic Forecast*, ed. McGraw-Hill, 4^a edición.

Revistas

Direcciones de internet de interés