

I. DATOS XERAIS DA MATERIA

a) Nome oficial	Introducción a la Econometría
b) Titulación	ADE
c) Créditos	6 (Teóricos 4,5; Prácticos 1,5)
d) Curso	Tercero
e) Código da materia	611211302
f) Tipo	Troncal
g) Impartición	Segundo Cuatrimestre
h) Departamento responsable	Economía Aplicada II
i) Profesora responsable da docencia	María Ramil Díaz

Información por grupo

1) Nome e apelidos da profesora que impartirá docencia

María Ramil Díaz

2) Lugar e horario de titorías

Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales. Despacho N° 328 (Tercera Planta).

Primer Cuatrimestre: Martes y Jueves, de 10:00 a 13:00 h.

Segundo Cuatrimestre: Miércoles y Jueves, de 9:00 a 12:00 h.

3) E-mail

4) Universidade Virtual

5) Lingua na que se impartirá a docencia

Castellano

II. OBXETIVOS DA MATERIA

Proporcionar una panorámica general de la econometría destacando la utilidad de los instrumentos que aporta y sus aplicaciones en el contexto de la ciencia económica, introducir la terminología y el lenguaje econométrico e iniciar el aprendizaje de los conceptos y de algunas herramientas básicas para el análisis cuantitativo y empírico de la economía.

III. METODOLOXÍA

Las clases teóricas se basan fundamentalmente en la exposición oral complementada con la utilización de medios audiovisuales e incluyen ejemplos y ejercicios que

permiten destacar las posibilidades y limitaciones de cada una de las técnicas analizadas. En las clases prácticas, parte de las cuales se imparten en grupos reducidos en el aula de informática, se introducen los fundamentos acerca de las rutinas de cálculo para resolver los problemas empíricos en economía mediante la utilización del programa Econometric Views, y se incluyen aplicaciones de los métodos teóricos con datos reales.

IV. AVALIACIÓN

Se basa en una prueba final escrita en la que se combinan preguntas conceptuales con otras de razonamiento para interrelacionar contenidos, y una aplicación con la que se adjuntará una salida de ordenador para su interpretación. Para superar la asignatura los alumnos deben demostrar una mínima competencia en cada una de las partes (teoría y práctica) de las que consta. La calificación final podrá mejorar en hasta 0,5 puntos en función de la participación activa en las clases.

V. TEMAS OU BLOQUES DE CONTIDOS

TEMA 1. ECONOMETRÍA Y MODELOS ECONOMÉTRICOS

- 1.1 Concepto de econometría. Modelos econométricos
- 1.2 Metodología de la investigación en econometría
- 1.3 Elementos de los modelos econométricos
- 1.4 Clases de modelos

TEMA 2. EL MODELO DE REGRESIÓN LINEAL CLÁSICO

- 2.1 Hipótesis básicas
- 2.2 El método de estimación MCO. El estimador de la varianza de la perturbación
- 2.3 Propiedades de los estimadores
- 2.4 Análisis de la bondad del ajuste

TEMA 3. INFERENCIA EN EL MODELO CLÁSICO

- 3.1 Introducción de la hipótesis de normalidad
- 3.2 Distribución de la Suma de Cuadrados de Errores
- 3.3 El método de estimación de mínimos cuadrados con restricciones
- 3.4 Contrastes de hipótesis sobre los parámetros. Estimación por intervalo
- 3.5 Estimación máximo verosímil

TEMA 4. PREDICCIÓN EN EL MODELO CLÁSICO

- 4.1 Predicción puntual y predicción por intervalo
- 4.2 El error de predicción. Esperanza matemática y varianza
- 4.3 Medidas evaluadoras de la capacidad predictiva
- 4.4 Análisis de la estabilidad postmuestral

TEMA 5. VARIABLES FICTICIAS

- 5.1 Introducción
- 5.2 Utilidades de las variables ficticias en los modelos de regresión. Ejemplos
- 5.3 La estabilidad de los parámetros en el período muestral

VI. RECOMENDACIONES

Para cursar esta materia se requieren conocimientos previos de teoría económica general (micro y macroeconomía), estadística (descriptiva y teórica) y matemáticas (álgebra y cálculo). Además, dado que las aplicaciones econométricas imponen la utilización de datos, es importante conocer la estructura y el contenido de las principales fuentes de información estadística.

VII. FONTES DE INFORMACIÓN

ARRANZ, M.; LODEIRO, M.J.; RAMIL, M. (2004). Introducción a la Econometría. Notas, Ejercicios y Aplicaciones. NINO, Centro de Impresión Digital. A Coruña.

CARRASCAL, U.; GONZÁLEZ, Y.; RODRÍGUEZ, B. (2001): Análisis econométrico con Eviews. RA – MA. Madrid.

GUISÁN, M.C. (1997): Econometría. McGraw – Hill. Madrid

MADDALA, G.S. (1996): Introducción a la Econometría (2ª edición). Prentice – Hall. Madrid.

MARTÍN, G.; LABEAGA, J.M.; MOCHÓN, F. (1997): Introducción a la Econometría. Prentice – Hall. Madrid.

PENA, J.B.; ESTAVILLO, M.E.; GALINDO, M.E.; LECETA, M.J.; ZAMORA, M.M. (1999): Cien ejercicios de Econometría. Pirámide. Madrid.

URIEL, E.; CONTRERAS, D.; MOLTÓ, M.; PEIRÓ, A. (1990): Econometría. El modelo lineal. AC. Madrid.

A medida que se avanza en el conocimiento de las técnicas econométricas es recomendable la lectura de artículos en los que se han aplicado para resolver problemas reales de la economía, tales como los que pueden encontrarse en acceso libre en la página <http://www.usc.es/economet>

Se utilizarán, además, otros libros de texto, distintas fuentes de datos y material disponible en la red, que se irán detallando durante el curso.