

I. DATOS XERAIS DA MATERIA

a) Nome oficial.	Econometría
b) Titulación.	ADE
c) Créditos	9 (Teóricos 6; Prácticos 3)
d) Curso.	Cuarto
e) Código da materia.	611211403
f) Tipo.	Troncal
g) Impartición.	Anual
h) Departamento/s responsable/s.	Economía Aplicada II
i) Profesor/a coordinador/responsable da docencia	Carla Rey Graña

Información por grupo (A;B)

1) Nome e apelidos do profesor/a que impartirá docencia

Carla Rey Graña

2) Lugar e horario de titorías

Facultad Ciencias Económicas y Empresariales. Despacho Nº 327 (Tercera planta)

Lunes, de 9:30 a 12:30

Martes, de 9:30 a 12:30

3) E-mail

carlarey@udc.es

4) Universidade Virtual

5) Lingua na que se impartirá a docencia

Español

II. OBXECTIVOS DA MATERIA

Proporcionar al alumno una panorámica general de la Econometría econométrica, ampliando los conocimientos adquiridos en Introducción a la Econometría, a fin de capacitar ala alumno para abordar el trabajo empírico empleando en cada momento la metodología más apropiada.

III. METODOLOXÍA

Se basará en una combinación de clases teóricas, que se impartirán mediante el procedimiento de lección magistral y clases prácticas que se utilizarán como medio para ilustrar la aplicación de los conocimientos adquiridos en las teóricas.

IV. AVALIACIÓN

Se efectuarán dos exámenes parciales, en el que se combinarán preguntas conceptuales con otras de razonamiento que permitan interrelacionar contenidos y una aplicación con la que se adjuntará una salida de ordenador para su interpretación.

V. TEMAS OU BLOQUES DE CONTIDOS

TEMA 1. REVISIÓN DEL MRLC

I.- ESPECIFICACIÓN

TEMA 2. ERROR DE ESPECIFICACIÓN.

- 2.1. Introducción
- 2.2. Error de especificación en la forma funcional. Contraste RESET
- 2.3. Error de especificación en la selección de variables explicativas
 - 2.3.1. Omisión de variables explicativas relevantes.
 - 2.3.2. Inclusión de variables explicativas irrelevantes.
- 2.4. Métodos de selección de regresores

II.- INCUMPLIMIENTO DE HIPÓTESIS RELATIVAS AL COMPORTAMIENTO DE LA PERTURBACIÓN ALEATORIA

TEMA 3. ESPERANZA MATEMÁTICA NO NULA Y NO NORMALIDAD

- 3.1. Esperanza matemática del vector de perturbaciones no nula.
 - 3.1.1. Esperanza no nula y variable
 - 3.1.2. Esperanza no nula y constante
- 3.2. No normalidad

TEMA 4.- EL MODELO DE REGRESIÓN LINEAL GENERALIZADO

- 4.1. Consecuencias del incumplimiento de la hipótesis de matriz de varianzas-covarianzas de la perturbación escalar
- 4.2. Hipótesis del modelo
- 4.3. El método de MCG
- 4.4. Propiedades de los estimadores MCG
- 4.5. El método de la matriz de transformación
- 4.6. Estimación por intervalo y contraste de hipótesis.
- 4.7. Predicción óptima en el modelo generalizado

EL SUPUESTO DE HETEROCEDASTICIDAD

- 4.8. Causas
- 4.9. Esquemas de heterocedasticidad
- 4.10. Detección de la heterocedasticidad: métodos gráficos y contrastes.
- 4.11. Soluciones a la heterocedasticidad.

EL SUPUESTO DE AUTOCORRELACIÓN

- 4.12. Causas
- 4.13. Esquemas de autocorrelación
- 4.14. Detección de la autocorrelación: métodos gráficos y contrastes
- 4.15. Soluciones a la autocorrelación.

III.- INCUMPLIMIENTO DE HIPÓTESIS ESTRUCTURALES

TEMA 5.- INSUFICIENCIA DE RANGO. MULTICOLINEALIDAD PERFECTA

TEMA 6.- LA ESTABILIDAD EN EL PERÍODO MUESTRAL

- 6.1. Contraste de Chow
- 6.2. Estimación recursiva.
- 6.3. CUSUM y CUSUMQ.

TEMA 7.- REGRESORES ESTOCÁSTICOS I

- 7.1. Modelos de regresión lineal con regresores estocásticos independientes de la perturbación.
- 7.2. Modelo de regresión lineal con regresores estocásticos dependientes de la perturbación.
 - 7.2.1. Incorrelación contemporánea
 - 7.2.2. Correlación contemporánea.
- 7.3. Método de variables instrumentales.

TEMA 8.- REGRESORES ESTOCÁSTICOS II. MODELOS MULTIECUACIONALES

- 8.1. Introducción
- 8.2. Modelos de ecuaciones aparentemente no relacionadas
 - 8.2.1. Estructura
 - 8.2.2. Estimación
- 8.3. Modelos recursivos e interdependientes
 - 8.3.1. Especificación. Forma estructural y forma reducida
 - 8.3.2. El problema de la identificación. Métodos de análisis.
 - 8.3.3. Métodos de estimación. Comparación de resultados.

IV.- MODELOS DE SERIES TEMPORALES Y MODELOS CON RETARDOS

TEMA 9. MODELOS DE PREDICCIÓN UNIVARIANTE

- 9.1. Introducción y conceptos básicos
- 9.2. Modelos autorregresivos (AR), de medias móviles (MA) y mixtos (ARMA)
- 9.3. Modelos mixtos integrados (ARIMA): concepto e identificación
- 9.4. Estimación, validación y predicción con modelos ARIMA

TEMA 10. MODELOS DINÁMICOS CON RETARDOS

- 10.1 Naturaleza de los retardos en economía
- 10.2 Modelos de ajuste parcial y de expectativas adaptativas y racionales
- 10.3 Modelos de retardos distribuidos: con estructura finita (retardos polinomiales de Almon) y con estructura infinita (esquema de Koyck)

VI. RECOMENDACIONES

Para cursar esta materia se requiere conocimientos de la asignatura Introducción a la Econometría, de teoría económica general (micro y macroeconomía); estadística (descriptiva y teórica) y matemáticas (álgebra y cálculo). Además, para las aplicaciones se requieren conocimientos previos del programa EconometricViews. Finalmente, 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>

VII. FONTES DE INFORMACIÓN

- Carrascal, U. Y González, Y. Y Rodríguez B. (2001).** *Análisis econométrico con EVIEWS. RA-MA.* Madrid.
- Guisán, M.C. (1997).** *Econometría.* McGraw-Hill. Madrid.
- Gujarati, D. (1997).** *Econometría.* 3ª edición. McGraw-Hill. Santa Fe de Bogotá.
- Johnston, J. Y Dinardo, J. (2001).** *Métodos de Econometría.* Vicens-Vives. Barcelona.
- Maddala, G.S. (1996).** *Introducción a la Econometría.* 2ª edición. Prentice-Hall. México.
- Martín, G., Labeaga, J.M. y Mochón, F. (1997).** *Introducción a la Econometría.* Prentice-Hall. Madrid.
- Otero, J.M. (1993).** *Econometría. Series temporales y predicción.* AC. Madrid
- Pena, J.B., Estavillo, J.A., Galindo, M.E., Leceta, M.J. y Zamora M.M. (1999).** *Cien ejercicios de Econometría.* Pirámide. Madrid.
- Pulido, A. y López, A. (1999).** *Predicción y simulación aplicada a la Economía y Gestión de Empresas.* Pirámide. Madrid.
- Pulido, A. y Pérez, J. (2001).** *Modelos econométricos.* Pirámide. Madrid.
- Ramil Díaz, M y Arranz Pérez, M. (2004).** *Modelos de ecuaciones simultáneas.*
- Uriel, E.; Contreras, D.; Moltó, M. Y Peiró, A. (1990).** *Econometría. El modelo lineal.* AC. Madrid.

