

TITULACIÓN: Licenciatura de ADE y Derecho

DEPARTAMENTO: Métodos Cuantitativos para la Economía y la Empresa

ÁREA: Métodos Cuantitativos para la Economía y la Empresa

<i>Asignatura:</i>	ECONOMETRIA I
<i>Código:</i>	07P7
<i>Curso:</i>	5º
<i>Cuatrimestre:</i>	1
<i>Créditos:</i>	6

Profesorado

Nombre	Despacho	E-mail
Susana Álvarez Díez	C4/01B	salvarez@um.es
Maribel González Martínez	C3/03	maribel@um.es

1. BREVE DESCRIPCIÓN DEL CONTENIDO Y OBJETIVOS

Con este primer curso de econometría, se pretende que el alumno aprenda los elementos básicos del análisis econométrico, útiles en aplicaciones simples, y aptos para el trabajo de econometría empírica con datos de corte transversal. Al terminar el curso, el alumno debe ser capaz de entender e interpretar resultados econométricos, especialmente aquellos propios de los datos de corte transversal, y ser capaz de llevar a cabo un estudio econométrico aplicado simple..

Las clases se repartirán entre clases teóricas y clases de práctica en ordenador, destinadas a concretar los conocimientos teóricos adquiridos en la clase teórica y a proporcionar conocimientos directamente aplicables a problemas económicos del mundo real.

2. CRITERIOS DE EVALUACIÓN

Para evaluar la adquisición de conocimientos por parte del alumno, se procederá a un examen que se desarrollará, previsiblemente, en el aula de informática. El examen constará de una única parte y se mezclarán preguntas de teoría y de práctica en ordenador. Hará falta obtener al menos 5 puntos sobre 10 para poder superar la asignatura.

3. PROGRAMA DE LA ASIGNATURA

Bloque I: El modelo lineal clásico

Tema 1. Introducción a la econometría

- 1.1. Introducción
- 1.2. Primera aproximación al problema econométrico
- 1.3. La estadística descriptiva que necesitaremos
- 1.4. La estadística inferencial que necesitaremos
- 1.5. Bases de datos

Tema 2. El modelo de regresión lineal

- 2.1. Introducción
- 2.2. El modelo de regresión clásico
- 2.3. Los supuestos clásicos
- 2.4. Interpretación intuitiva

Tema 3. El método MCO

- 3.1. Introducción
- 3.2. El método MCO
- 3.3. El método MV

Tema 4. Propiedades de la estimación MCO

- 4.1. Introducción
- 4.2. Bondad del ajuste
- 4.3. Propiedades de la media estimada
- 4.4. Propiedades de la varianza estimada

Tema 5. Inferencia y predicción

- 5.1. Introducción
- 5.2. Estimación restringida
- 5.3. Estimación por intervalos
- 5.4. Predicción

Bloque II: Extensiones al modelo lineal clásico

Tema 6. Multicolinealidad

- 6.1. Introducción
- 6.2. Multicolinealidad exacta
- 6.3. Multicolinealidad aproximada
- 6.4. Conclusión

Tema 7. Variables ficticias

- 7.1. Introducción
- 7.2. Definición y concepto
- 7.3. Variables ficticias únicas con dos estados
- 7.4. Variables ficticias más generales

Tema 8. Heteroscedasticidad

- 8.1. Introducción
- 8.2. Definición y concepto
- 8.3. El método Mínimos Cuadrados Generalizados
- 8.4. Métodos para detectar la heteroscedasticidad
- 8.5. Solución al problema de heteroscedasticidad

Manuales de referencia:

- 1.- Wooldridge, Jeffrey M., 2006, Introducción a la Econometría –Un enfoque moderno. Segunda edición. Thomson, Madrid
- 2.- Stock, J. y Watson, M. Introduction to Econometrics. Segunda edición. Pearson Addison-Wesley.