

10-11

GUÍA DE ESTUDIO DE LDI



ECONOMETRIA I

CÓDIGO 01424032

10-11

ECONOMETRIA I

CÓDIGO 01424032

ÍNDICE

OBJETIVOS

CONTENIDOS

EQUIPO DOCENTE

BIBLIOGRAFÍA BÁSICA

BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA

SISTEMA DE EVALUACIÓN

HORARIO DE ATENCIÓN AL ESTUDIANTE

OBJETIVOS

La asignatura Econometría I tiene como objetivo principal el aprendizaje de los modelos multiecuacionales, cuyo estudio se aborda desde los diferentes desarrollos metodológicos implementados para su resolución. Así se diferencian tres metodologías diferentes: Modelos de Ecuaciones Simultáneas, Modelos Recursivos y Modelos VAR (Vectores Autorregresivos). El programa se completa con el estudio de los Modelos con Variables Cualitativas, Métodos de Estimación No Lineales y Modelos con Errores en las Variables. En definitiva, se trata de ofrecer al alumno una panorámica general de la metodología econométrica, ampliando los conocimientos adquiridos en Introducción a la Econometría, proporcionándole así un bagaje de conocimientos que le capaciten para abordar el trabajo empírico empleando en cada momento la metodología más adecuada.

CONTENIDOS

Dadas sus características, la asignatura de Econometría I está estrechamente ligada con los conocimientos contenidos en la asignatura de 3.^o Curso, *Introducción a la Econometría*, impartida también en ambas licenciaturas; también está muy relacionada con los contenidos de las siguientes asignaturas: *Introducción a la Estadística* (1.^o de ADE y Economía), *Estadística Empresarial* (2.^o de ADE), *Estadística Teórica I* (2.^o de Economía) y *Estadística Teórica II* (3.^o de Economía), y con los contenidos de *Matemáticas I* (1.^o de ADE y Economía), fundamentalmente con los temas de Álgebra Matricial.

Por ello, se requiere que el alumno tenga un conocimiento avanzado del método de estimación por Mínimos Cuadrados Ordinarios (MCO) así como de cálculo matricial e inferencia estadística, sin los cuales el estudio de la asignatura no puede ser concebido.

El temario se compone de los siguientes epígrafes:

TEMA 1. Modelos con variables cualitativas. (Cap. 5 Bibliografía Básica).

TEMA 2. Modelos con variable dependiente dicotómica. (Cap. 5 Bibliografía Básica).

TEMA 3. Modelos estructurales multiecuacionales. (Cap. 7 Bibliografía Básica).

TEMA 4. Métodos de estimación de modelos simultáneos I. (Cap. 8 Bibliografía Básica).

TEMA 5. Métodos de estimación de modelos simultáneos II. (Cap. 8 Bibliografía Básica).

TEMA 6. Modelos recursivos. (Cap. 8 Bibliografía Básica).

TEMA 7. Modelos VAR. (Cap. 10 Bibliografía Básica).

TEMA 8. Métodos de estimación no lineales. (Cap. 11 Bibliografía Básica).

TEMA 9. Modelos con errores en las variables. (Cap. 4 Bibliografía Básica).

EQUIPO DOCENTE

Nombre y Apellidos
Correo Electrónico
Teléfono
Facultad
Departamento

ALBERTO MUÑOZ CABANES
amunoz@cee.uned.es
91398-8706
FAC.CIENCIAS ECONÓMICAS Y EMPRESARIALES
ECONOMÍA APLICADA Y ESTADÍSTICA

Nombre y Apellidos
Correo Electrónico
Teléfono
Facultad
Departamento

ANGEL MUÑOZ ALAMILLOS
amunoz@cee.uned.es
91398-6393
FAC.CIENCIAS ECONÓMICAS Y EMPRESARIALES
ECONOMÍA APLICADA Y ESTADÍSTICA

Nombre y Apellidos
Correo Electrónico
Teléfono
Facultad
Departamento

ALFONSO HERRERO DE EGAÑA ESPINOSA DE LOS MONTEROS
alherrero@cee.uned.es
91398-7800
FAC.CIENCIAS ECONÓMICAS Y EMPRESARIALES
ECONOMÍA APLICADA Y ESTADÍSTICA

BIBLIOGRAFÍA BÁSICA

ISBN(13):9788496062948

Título:ECONOMETRÍA APLICADA (1ª)

Autor/es:Muñoz Cabanes, Alberto ; Parra Rodríguez, Francisco ;

Editorial:EDICIONES ACADÉMICAS, S.A. (EDIASA)

MUÑOZ CABANES, A. y PARRA RODRÍGUEZ, F. J. (2007), *Econometría Aplicada*, Ediciones Académicas, 1.^a edición.

Contacto Editorial: Ediciones Académicas S.A., C\ Bascuñuelos 13, 28201 Madrid. Teléfono 91 710 91 20

BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA

ISBN(13):9788436224962

Título:ECONOMÍA APLICADA CUANTITATIVA I (2ª)

Autor/es:García Sestafe, José Vicente ; Rodríguez Ruiz, Julián ; Prieto Sáez, Emilio ; Álvarez Vázquez, Nelson Julio ; Alcaide Inchausti, Ángel ;

Editorial:U.N.E.D.

ISBN(13):9788436233292

Título:ECONOMETRÍA I (1ª)

Autor/es:Álvarez Vázquez, Nelson Julio ;

Editorial:U.N.E.D.

ISBN(13):9788436808421

Título:EJERCICIOS DE ECONOMETRÍA II (1)

Autor/es:Aznar Grasa, A. ;

Editorial:EDICIONES PIRÁMIDE, S.A.

ISBN(13):9788436815344

Título:MODELOS ECONOMÉTRICOS (1)

Autor/es:Pulido San Román, Antonio ;

Editorial:EDICIONES PIRÁMIDE, S.A.

ISBN(13):9788480044196

Título:ECONOMETRÍA I. MODELOS ECONOMÉTRICOS ESTRUCTURALES
MULTIECUACIONALES Y OTRAS CUESTIONES (1ª)

Autor/es:Álvarez Vázquez, Nelson Julio ;

Editorial:CERA

ISBN(13):9788483220078

Título:ANÁLISIS ECONOMÉTRICO (3ª)

Autor/es:Greene, W.H. ;

Editorial:PEARSON

ISBN(13):9789701039717

Título:ECONOMETRÍA (4ª)

Autor/es:Gujarati, D. ;

Editorial:MC GRAW HILL

ALCAIDE INCHAUSTI, A. et al. (1990), *Economía Aplicada Cuantitativa I*, Cuadernos de la UNED n.º 188, UNED.

ÁLVAREZ VÁZQUEZ, N. (2000), *Econometría I*, Ed. CERA.

AMEMIYA, T. (1985), *Advanced Econometrics*, Ed. Basil Blackwell

AZNAR GRASA, A. et al. (1984), *Ejercicios de Econometría II*, Ed. Pirámide.

GREENE, W. H. (2000), *Análisis Econométrico*, Ed. Prentice Hall.

GUJARATI, D. (2003), *Econometría*, Ed. McGraw-Hill 4.ª edición.

JOHNSTON, J y DINARDO, J. (2001), *Métodos de Econometría*, Ed. Vicens-Vives 3.ª edición.

JUDGE, G. G. et al. (1982), *Introduction to the Theory and Practice of Econometrics*, Ed. John Wiley & Sons, 2.ª edición.

MADDALA, G.S. (1977), *Econometría*, Ed. McGraw-Hill.

MUÑOZ CABANES, A. y PARRA RODRÍGUEZ, F. J. (2004), *Econometría*, Ediciones Académicas.

NOVALES, A. (1993), *Econometría*, Ed. McGraw-Hill.

PINDYCK, R.S y RUBINFELD, D.L. (1980), *Modelos Econométricos*, Ed. Labor.

PULIDO SAN ROMÁN, A. (1987), *Modelos Económicos*, Ed. Pirámide.

WALLIS, K. F. (1972), *Introducción a la Econometría*, Alianza Universidad.

SISTEMA DE EVALUACIÓN

Para superar la asignatura, el alumno habrá de demostrar una mínima preparación de cada uno de los apartados del temario, estudiando la bibliografía recomendada y realizando un examen, el cual constará de una parte teórica y una parte práctica.

Para la correcta resolución de la parte teórica, el alumno deberá conocer el contenido de la asignatura de modo conceptual. Por su parte, para la resolución de la prueba práctica sólo se exigirá el conocimiento de los modelos multiecuacionales simultáneos y recursivos.

HORARIO DE ATENCIÓN AL ESTUDIANTE

El horario de consulta será los Lunes lectivos de 16 a 20 h. El lugar de consulta será el siguiente:

UNED

Facultad de CC Económicas y Empresariales

Despacho 1.23

Paseo Senda del Rey, 11

28040 Madrid

Tel.: 91 398 87 06

Fax: 91 398 63 35

Correo electrónico: amunoz@cee.uned.es

INFORME DEL PROFESOR TUTOR

Siempre será valorado positivamente.

IGUALDAD DE GÉNERO

En coherencia con el valor asumido de la igualdad de género, todas las denominaciones que en esta Guía hacen referencia a órganos de gobierno unipersonales, de representación, o miembros de la comunidad universitaria y se efectúan en género masculino, cuando no se hayan sustituido por términos genéricos, se entenderán hechas indistintamente en género femenino o masculino, según el sexo del titular que los desempeñe.