

ECONOMETRÍA

Curso 2011/2012

(Código:25503022)

1.PRESENTACIÓN

En línea con el objetivo del Máster, esta asignatura pretende proporcionar un conocimiento econométrico riguroso con el que el alumno pueda abordar la investigación en el campo de la economía, donde la econometría se ha convertido en una herramienta imprescindible.

El objetivo básico de la econometría tiene que ver con el uso de herramientas estadísticas y matemáticas para contrastar teorías previamente establecidas por la economía, o para evaluar los efectos de políticas alternativas. El instrumento fundamental con el que trata de alcanzarse este objetivo, es el modelo clásico de regresión y alguna de sus extensiones.

2.CONTEXTUALIZACIÓN

En el diseño del Máster la Econometría pertenece al primer módulo y es una asignatura obligatoria. Está directamente relacionada con el objetivo fundamental del Máster, que pretende capacitar al alumno para llevar a cabo actividades de investigación en el campo económico y tiene 6 ECTS, lo que equivale a 150 horas de trabajo aproximadamente.

3.REQUISITOS PREVIOS RECOMENDABLES

Se asume que el alumno tiene conocimientos básicos de estadística, probabilidad, cálculo, álgebra matricial y teoría económica y los propios de un curso de introducción a la econometría. Los conceptos matemáticos y estadísticos necesarios se encuentran recogidos en los temas 2, 3, 4 y 5 de la bibliografía básica, especialmente en los tres primeros, aunque ninguno de estos temas forma parte del programa.

Es asimismo recomendable tener un nivel de inglés suficiente para leer textos en este idioma.

4.RESULTADOS DE APRENDIZAJE

Manejo riguroso de la modelización y tratamiento adecuado de sus problemas empleando modelos de regresión simple y múltiple, modelos con datos de panel y modelos de respuesta cualitativa.

5.CONTENIDOS DE LA ASIGNATURA

La asignatura comprende los siguientes temas,

1. El modelo clásico de regresión lineal: especificación y estimación
2. Inferencia y predicción con el modelo de regresión
3. Formas funcionales, no linealidad y especificación
4. Problemas con los datos



5. Heteroscedasticidad
6. Autocorrelación
7. Modelos con datos de panel
8. Modelos de respuesta cualitativa

6.EQUIPO DOCENTE

- [PEDRO ANTONIO PEREZ PASCUAL](#)
- [BASILIO SANZ CARNERO](#)
- [MARIANO MATILLA GARCIA](#)

7.METODOLOGÍA

Aunque se organizarán sesiones presenciales, el desarrollo del curso implica el estudio autónomo del contenido del programa así como la realización de diversos ejercicios teóricos y prácticos.

8.BIBLIOGRAFÍA BÁSICA

ISBN(13): 9788483220078
Título: ANÁLISIS ECONÓMICO (3ª)
Autor/es: Greene, W.H. ;
Editorial: PEARSON

Buscarlo en librería virtual UNED

Buscarlo en bibliotecas UNED

Buscarlo en la Biblioteca de Educación

Buscarlo en Catálogo del Patrimonio Bibliográfico

9.BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA

ISBN(13): 9780195123722
Título: ECONOMETRIC THEORY AND METHODS (1st)
Autor/es: Mackinnon, J.G. ; Davidson, R. ;
Editorial: : OXFORD UNIVERSITY PRESS

Buscarlo en librería virtual UNED

Buscarlo en bibliotecas UNED

Buscarlo en la Biblioteca de Educación

Buscarlo en Catálogo del Patrimonio Bibliográfico



ISBN(13): 9788497322683

Título: INTRODUCCIÓN A LA ECONOMETRÍA. UN ENFOQUE MODERNO (SEGUNDA)

Autor/es: Wooldridge, J. M. ;

Editorial: : THOMSON-PARANINFO

Buscarlo en librería virtual UNED

Buscarlo en bibliotecas UNED

Buscarlo en la Biblioteca de Educación

Buscarlo en Catálogo del Patrimonio Bibliográfico

10. RECURSOS DE APOYO AL ESTUDIO

Debe manejarse con soltura el paquete econométrico *Gretl*. Dicho programa (y los manuales de funcionamiento) puede descargarse gratuitamente desde la dirección,

gretl.sourceforge.net/gretl_espanol.html

11. TUTORIZACIÓN Y SEGUIMIENTO

Se celebrarán reuniones presenciales periódicas a lo largo del cuatrimestre.

12. EVALUACIÓN DE LOS APRENDIZAJES

La evaluación se llevará a cabo mediante una prueba escrita de 2 horas de duración. Tendrá lugar al final de cuatrimestre y en ella el alumno habrá de responder a cuestiones de naturaleza tanto teórica como aplicada referidas al programa de la asignatura.

La asistencia a las sesiones presenciales y la resolución de los ejercicios propuestos, se valorará positivamente en la calificación final.

13. COLABORADORES DOCENTES

Véase equipo docente.

