

ECONOMETRÍA

Curso 2016/2017

(Código: 25503022)

1. PRESENTACIÓN

En línea con el resto de los objetivos del Máster, se 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, encontrar efectos causales o para evaluar los efectos de políticas. El instrumento fundamental con el que trata de alcanzarse este objetivo, es el modelo clásico de regresión y sus principales 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 posee 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 pueden repasarse por ejemplo en Greene, W.H. (tercera edición), capítulos 2, 3, 4 y 5 especialmente en los tres primeros.

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. En concreto al finalizar el curso el alumno ha de ser capaz de,

- a) Reconocer el MCRL como herramienta básica en la investigación cuantitativa
- b) Comprender los principales métodos de estimación e interpretar adecuadamente los resultados obtenidos con los mismos en situaciones prácticas concretas
- c) Utilizar el MCRL para contrastar hipótesis de interés económico, analizar el efecto de políticas económicas, estudiar efectos causales o realizar predicciones
- d) Identificar los principales problemas que el MCRL presenta en la práctica y ser capaz de proporcionar soluciones
- e) Conocer los modelos apropiados para el tratamiento de datos de panel o variables cualitativas
- f) Plantear problemas de interés en el ámbito de la Economía y emplear los métodos anteriores para tratar de solucionarlos
- g) Manejar con soltura software econométrico

5.CONTENIDOS DE LA ASIGNATURA

La asignatura se desarrolla en torno a los siguientes temas,

1. El modelo clásico de regresión lineal: especificación y estimación
2. Inferencia y predicción con el modelo de regresión
3. Modelos de regresión con heterocedasticidad y autocorrelación
4. Análisis de especificación y problemas con los datos
5. Regresión con variables instrumentales
6. Modelos con datos de panel
7. Modelos con variable dependiente binaria

6.EQUIPO DOCENTE

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

7.METODOLOGÍA

La preparación del programa implica el estudio autónomo del contenido del mismo así como la realización de diversos ejercicios teóricos y prácticos. El alumno puede consultar al Equipo Docente las dudas y dificultades que pudieran surgirle en el proceso. Las consultas se realizarán preferentemente en el Curso Virtual o por correo electrónico (pperez@cee.uned.es).

8.BIBLIOGRAFÍA BÁSICA

ISBN(13): 9788448183103

Título: ECONOMETRÍA Y PREDICCIÓN

Autor/es: Matilla García, Mariano ; Pérez Pascual, Pedro A. ; Sanz Carnero, Basilio ;

Editorial: : MCGRAW-HILL/INTERAMERICANA DE ESPAÑA

Buscarlo en librería virtual UNED

Buscarlo en bibliotecas UNED

Buscarlo en la Biblioteca de Educación

Buscarlo en Catálogo del Patrimonio Bibliográfico

Comentarios y anexos:

9.BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA

ISBN(13): 9780262232586

Título: ECONOMETRIC ANALYSIS OF CROSS SECTION AND PANEL DATA (SEGUNDA)

Autor/es: Wooldridge, J. M. ;

Editorial: THE MIT PRESS

Buscarlo en librería virtual UNED

Buscarlo en bibliotecas UNED

Buscarlo en la Biblioteca de Educación

Buscarlo en Catálogo del Patrimonio Bibliográfico

ISBN(13): 9788483220078

Título: ANÁLISIS ECONOMÉTRICO (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

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 algún paquete econométrico. Se recomienda *Gretl*. Tanto el programa como los manuales pueden descargarse gratuitamente desde la dirección,

gretl.sourceforge.net/gretl_espanol.html

11. TUTORIZACIÓN Y SEGUIMIENTO

A través de Curso Virtual se propondrán actividades cuya realización será voluntaria y podrá ser tomada en cuenta para la calificación final.

El alumno podrá consultar con el Equipo Docente cualquier detalle referido a la preparación de la asignatura que estime oportuno. Para ello, además del Curso Virtual, puede emplear el correo electrónico (pperez@cee.uned.es), el contacto telefónico (91 3987801) o personal, previa concertación de una cita.

El horario de guardia será los miércoles de 16 a 20 horas en el despacho 1.22 de la Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales.

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.

Asimismo a lo largo del curso tendrán lugar dos pruebas de evaluación continua de carácter voluntario que serán tenidas en cuenta en la nota final. Dichas pruebas serán de tipo test y se realizarán on line con la aplicación incluida al efecto en el curso virtual de la asignatura. Se celebrarán en el horario señalado por el Equipo Docente y podrá usarse cualquier tipo de material.

La calificación final de aquellos alumnos que no hagan dichas pruebas, dependerá exclusivamente de la nota obtenida en la prueba presencial escrita.

13.COLABORADORES DOCENTES

Véase equipo docente.