

## **ECONOMETRÍA III**

### **PLAN DEL CURSO 2012-2013**

#### **1.- PROFESORADO.**

Clases Teóricas: Antonio Aznar Grasa

Clases Prácticas: María Teresa Aparicio Aspas

Javier Nievas Lopez.

#### **2.- TUTORÍAS.**

A lo largo del curso se observará estrictamente el siguiente horario

	<b>Lunes</b>	<b>Martes</b>	<b>Miércoles</b>	<b>Jueves</b>	<b>Viernes</b>
AZNAR, A.			12-13 17,30-18,30	12-13 17,30-18,30	12-14
APARICIO, M.	9,30-13,30		17-18	17-18	
NIEVAS, J.			10,30-13,30 17-20		

### **3.- CRITERIOS DE EVALUACIÓN.**

Se seguirá un procedimiento mixto basado en:

- Evaluación de los conocimientos teóricos mediante a realización de un examen.
- Evaluación de los conocimientos aplicados mediante la realización de un trabajo de econometría aplicada y un examen individual sobre los conocimientos informáticos.

El trabajo de econometría aplicada se realizará por grupos de máximo tres estudiantes y se entregará un informe escrito de 10 a 15 páginas. Sobre el contenido de este trabajo se realizarán evaluaciones periódicas en las que el estudiante comentará los resultados obtenidos. La fecha límite de entrega del trabajo será el día 10 de Enero.

El examen sobre conocimientos informáticos es obligatorio para los alumnos que realicen trabajo por lo que, de no presentarse a este examen, la nota de la evaluación práctica se minorará en 0,5 puntos.

Además, la calificación final se puede ver complementada con la realización de pequeñas pruebas que se irán realizando en las clases.

Los alumnos que hayan realizado trabajo y examen de conocimientos informáticos durante el curso 2011-2012 pueden mantener la calificación de los mismos para este curso académico. La realización de una nueva evaluación de la parte práctica implica automáticamente la renuncia a la nota obtenida en dicha parte en el curso anterior.

La nota final será el resultado de sumar el 75% de la nota del examen, con el 15% de la nota del trabajo y el 10% de la nota del examen de informática. Para obtener una calificación de sobresaliente es necesario realizar el trabajo.

Para los estudiantes que opten sólo por el examen, el contenido de éste será diferente al examen del procedimiento mixto.

### **4.- CLASES PRÁCTICAS.**

La lista de los integrantes de los grupos de trabajo deberá ser entregada al profesor antes del día 5 de Octubre, con posterioridad a dicha fecha no se admitirá la creación de nuevos grupos.

## **5.- PROGRAMA DE LA ASIGNATURA.**

### **TEMA 1 : INTRODUCCIÓN**

1. 1. Concepto de Ciencia Empírica.
1. 2. Etapas del proceso científico.
1. 3. La Economía como Ciencia Empírica.
1. 4. Etapas de un ejercicio de Econometría Aplicada.

### **TEMA 2 : REVISIÓN DE CONCEPTOS.-1. MARCO ESTACIONARIO**

2. 1. Modelo Lineal General.
2. 2. Regresores estocásticos.
2. 3. Métodos analíticos y Métodos de Montecarlo.

### **TEMA 3 : REVISIÓN DE CONCEPTOS-2. CONTRASTE DE HIPÓTESIS**

3. 1. Teoría del contraste de hipótesis. Conceptos básicos.
3. 2. Contrastes LR, W y LM.
3. 3. Contraste en el marco del Modelo Lineal General.

### **TEMA 4 : MARCO NO ESTACIONARIO**

4. 1. Series no estacionarias.
4. 2. Análisis univariante de las series.
4. 3. Contrastes del orden de integración.

### **TEMA 5 : MODELOS CON VARIABLES NO ESTACIONARIAS**

5. 1. Formas de los modelos.
5. 2. Cointegración. Contrastes.
5. 3. Modelo VAR y Modelo con Mecanismo de Corrección de Error.
5. 4. Métodos de estimación.

### **TEMA 6 : MODELOS ESFÉRICOS**

6. 1. Estacionariedad. Atípicos.
6. 2. Autocorrelación.
6. 3. Heteroscedasticidad.
6. 4. Normalidad.

## TEMA 7 : PREDICCIÓN

- 7. 1. Predicción MCO.
- 7. 2. Contrastes de Estabilidad Predictiva, Permanencia Estructural y Análisis de Corroboración.
- 7. 3. Predicción en modelos con variables no estacionarias.

## TEMA 8 : SELECCIÓN DE MODELOS

- 8. 1. Modelos y contrastes.
- 8. 2. Parsimonia y Ajuste.
- 8. 3. Análisis comparado de criterios.

### **6.- BIBLIOGRAFÍA BÁSICA.**

- AZNAR A. (2008) : “Curso de Econometría”. Edición revisada.
- AZNAR A. y F. J. TRÍVEZ (1993) : “Métodos de Predicción en Economía”. Ariel.

### **BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA.**

- AZNAR A., A. GARCÍA-FERRER y A. MARTÍN (1994) : “Ejercicios de Econometría” Pirámide.
- NOVALES A. (1993) : “Econometría”. McGraw-Hill
- TRÍVEZ F. J. (2004): “Introducción a la Econometría” Pirámide.