

PUBLICACIONES DE 4^{er} CURSO

Grado: Economía

Asignatura: ECONOMETRÍA III

PROGRAMA (2015-2016)

Profesores: Antonio Aznar y M^a Isabel Ayuda

Departamento de ANÁLISIS ECONÓMICO

Curso Académico 2015/16



**Facultad de
Economía y Empresa
Universidad Zaragoza**

PROGRAMA ECONOMETRIA III (2015-2016)

PARTE 1: FUNDAMENTOS Y REVISIÓN DE CONCEPTOS ESTADÍSTICOS

TEMA 1: FUNDAMENTOS

1. Preguntas relevantes
2. Efectos causales y experimentos
3. Tipos de datos
4. Usos de los modelos econométricos

Bibliografía

Notas de explicaciones en clase

Capítulo 1 del libro de Stock-Watson

Suplemento Docente 1: Uso de los Modelos Econométricos.

TEMA 2: REVISIÓN DE CONCEPTOS ESTADÍSTICOS

1. Variable Aleatoria y Distribución de Probabilidad.
2. Momentos: Esperanza y Varianza.
3. Distribución condicional.
4. Estimación.
5. Contrastes e intervalos de confianza

Bibliografía

Notas de explicaciones en clase

Capítulos 2 y 3 del libro de Stock-Watson

Suplemento Docente 2: Estimación Máximo-verosímil y contrastes

PARTE 2: REGRESORES ESTOCÁSTICOS

TEMA 3: MODELO LINEAL SIMPLE

1. Introducción
2. Estimación Mínimo Cuadrático Ordinaria (MCO)
3. Medidas de ajuste
4. Supuestos y propiedades de los MCO
5. Contrastes e intervalos de confianza

Bibliografía

Notas de explicaciones en clase
Capítulos 4 y 5 de Stock-Watson

TEMA 4: MODELO LINEAL GENERAL

1. Introducción: Sesgo de variable omitida
2. Estimadores Mínimo Cuadrático Ordinarios (MCO)
3. Medidas de ajuste
4. Contrastes
5. Variables de control

Bibliografía

Notas de explicaciones en clase
Capítulos 6 y 7 de Stock-Watson

TEMA 5: EVALUACIÓN

1. Validez interna y externa
2. Amenazas a la validez interna
3. Equilibrio sesgo-varianza
4. Forma funcional
5. Contrastes de esfericidad

Bibliografía

Notas de explicaciones en clase
Capítulo 8 y 9 de Stock-Watson
Suplemento Docente 3: Contrastes de esfericidad
Suplemento Docente 4: Criterios de Selección

PARTE 3: MODELOS DE SERIES TEMPORALES

TEMA 6: ANÁLISIS UNIVARIANTE

1. Series Estacionarias y no estacionarias
2. Tendencias Deterministas y Estocásticas
3. Contraste de Raíz unitaria: Dickey-Fuller
4. Revisión enfoque Box-Jenkins

Bibliografía

Notas de explicaciones en clase
Capítulo 14 de Stock-Watson

TEMA 7 : ANÁLISIS MULTIVARIANTE

1. Modelo VAR
2. Cointegración
3. Modelo con Mecanismo de Corrección del Error

Bibliografía

Notas de explicaciones en clase
Capítulo 16 de Stock-Watson

PARTE 4: OTROS TEMAS

TEMA 8. VARIABLES INSTRUMENTALES

1. Definición de Variable Instrumental
2. Criterios para validar la variable Instrumental
3. Mínimos Cuadrados en dos Etapas

Bibliografía

Notas de explicaciones en clase
Capítulo 12 de Stock-Watson

TEMA 9. MODELOS PARA DATOS PANEL

1. Motivación
2. Datos de Panel con dos periodos
3. Regresión de Efectos Fijos

Bibliografía

Notas de explicaciones en clase
Capítulo 10 de Stock-Watson

TEMA 10. MODELOS CON VARIABLE DEPENDIENTE BINARIA

1. Modelo de Probabilidad Lineal
2. Modelo Probit
3. Modelo Logit

Bibliografía

Notas de explicaciones en clase
Capítulo 11 de Stock-Watson

Stock, J.H and M.M. Watson (2012): Introducción a la Econometría. Ed: Pearson.

HORARIOS DE CLASE, AULAS Y PROFESORES

Grupos	Horario	Profesores	Aula
241	Miércoles: 15-17 (Sub. 1)	M ^a Isabel Ayuda (P)	14 A; Info 8
	Miércoles: 17-19 (Sub. 2)	Antonio Aznar (P)	14 A; Info 1
	Jueves: 17-19	Antonio Aznar (T)	17
242	Miércoles: 9-11 (Sub. 2)	M ^a Isabel Ayuda (P)	14 A; Info 1
	Miércoles: 11-13 (Sub. 1)	Antonio Aznar (P)	14 A; Info 1
	Jueves: 13-15	Antonio Aznar (T)	17

HORARIOS DE TUTORÍAS

	Lunes	Martes	Miércoles	Jueves	Viernes
A. Aznar	18:30-20:30		9:30-11	9:30-12	
M.I. Ayuda			11-13;17-19	9-11	

Estos horarios de tutorías podrán sufrir modificaciones puntuales que serán debidamente anunciadas.

CRITERIOS DE EVALUACIÓN DE LA ASIGNATURA ECONOMETRÍA III

La calificación final se determinará, para las dos convocatorias, por el máximo entre las dos siguientes opciones:

1. Examen final en la fecha que corresponda dentro de las convocatorias oficiales de exámenes.
 2. Ponderación entre el examen final (70%), dos pruebas voluntarias intermedias (10% cada una) y la participación en clase (10%).
- El examen final será en la fecha fijada por el calendario de exámenes del centro. Dicha prueba consistirá en algunas preguntas donde se ha de razonar la verdad o falsedad de las mismas y ejercicios teórico-prácticos del tipo a los realizados en las clases prácticas, donde puede haber alguna salida de Gretl para analizar (Gretl es el programa informático utilizado en las clases prácticas). Una de las preguntas versará sobre una lista de definiciones y conceptos básicos que se pondrá a disposición de los estudiantes durante el curso.

- Las pruebas intermedias serán de carácter teórico y teórico-práctico y con ellas se pretende comprobar si el estudiante es capaz de utilizar adecuadamente la terminología y los conceptos econométricos
- La calificación mínima para aprobar la asignatura será de 5 sobre 10 sin exigir nota mínima en ninguna de las pruebas.
- Para la evaluación de los alumnos de quinta y sexta convocatoria se remite al acuerdo de 22 de diciembre de 2010, del Consejo de Gobierno de la Universidad, por el que se aprueba el Reglamento de Normas de Evaluación del Aprendizaje. En dicho artículo se establece que el alumno realizará la evaluación ante un tribunal, aunque podrá optar a realizar el examen junto al resto de sus compañeros y entregar posteriormente el examen para que se lo corrija el tribunal.