

Econometría

MÁSTER UNIVERSITARIO EN ECONOMÍA Y FINANZAS

UNIVERSIDAD INTERNACIONAL MENÉNDEZ PELAYO

Este documento puede utilizarse como documentación de referencia de esta asignatura para la solicitud de reconocimiento de créditos en otros estudios. Para su plena validez debe estar sellado por la Secretaría de Estudiantes UIMP.



DATOS GENERALES

Breve descripción

Esta asignatura forma parte del Módulo I que contiene las asignaturas troncales cursadas durante los dos primeros trimestres del Máster. La mitad de este módulo está constituido por asignaturas que proporcionan los principales instrumentos de análisis empleados en economía, es decir, las Matemáticas y la Estadística, incluyendo en esta última una asignatura de Econometría. La otra mitad la constituyen asignaturas de análisis microeconómico y macroeconómico. Todas ellas conforman una base de conocimientos imprescindibles para un correcto aprovechamiento de las asignaturas del Módulo II.

Título asignatura

Econometría

Código asignatura

101115

Curso académico

2017-18

Planes donde se imparte

[MÁSTER UNIVERSITARIO EN ECONOMÍA Y FINANZAS](#)

Créditos ECTS

6

Carácter de la asignatura

OBLIGATORIA

Duración

Cuatrimestral

Idioma

Inglés

CONTENIDOS

Contenidos

- Análisis de regresión con series temporales.
- Simultaneidad y errores en las variables.
- Métodos de estimación e inferencia.
- Modelos de series temporales.
- Datos de panel.
- Elección discreta.

COMPETENCIAS

Generales

G1 - Demostrar unos sólidos conocimientos de teoría económica y de las técnicas económicas, econométricas y computacionales relevantes.

G2 - Aplicar los conocimientos adquiridos y ser capaz de resolver problemas en entornos nuevos o poco conocidos dentro de contextos más amplios o multidisciplinares relacionados con el estudio de la economía y las finanzas.

G3 - Integrar sus conocimientos y estar capacitado para formular juicios a partir de una información incompleta o limitada, que incluya reflexiones sobre las responsabilidades sociales y éticas vinculadas a la aplicación de sus conocimientos y juicios económicos.

G4 - Analizar de forma crítica, evaluar y sintetizar ideas nuevas y complejas en relación con teorías y metodologías empíricas en el ámbito de la economía.

Específicas

ET6 - Conocer los principales modelos y métodos de estimación e inferencia usados en la econometría, tanto para datos de series temporales como de corte transversal y de panel.

PLAN DE APRENDIZAJE

Actividades formativas

AF1.- Clases teóricas (30 horas)

AF2.- Clases prácticas (15 horas)

AF5.- Estudio del contenido teórico del curso (60 horas)

AF6.- Resolución de ejercicios prácticos (30 horas)

AF7.- Preparación de presentaciones en clase (15 horas)

Metodologías docentes

- Clases teóricas en las que se desarrollan los temas del programa de la asignatura.
- Clases prácticas en las que los alumnos resuelven ejercicios previamente distribuidos por el profesor.

Resultados de aprendizaje

- Conocer los principales modelos y métodos de estimación e inferencia usados en la econometría, tanto para datos de series temporales como de corte transversal y de panel.

SISTEMA DE EVALUACIÓN

Descripción del sistema de evaluación

SE1.- Ejercicios (ponderación mínima 0.05 y ponderación máxima 0.3)

SE2.- Presentaciones (ponderación mínima 0.05 y ponderación máxima 0.15)

SE4.- Exámenes (ponderación mínima 0.7 y ponderación máxima 0.95)

PROFESORADO

Profesor responsable

Arellano González, Manuel

Doctor en Economía, London School of Economics

Profesor de Econometría

Centro de Estudios Monetarios y Financieros (CEMFI)

Profesorado

Profesor Responsable de la asignatura

HORARIO

Horario

Esta asignatura forma parte del Módulo I, que se desarrolla en los trimestres primero y segundo.

BIBLIOGRAFÍA Y ENLACES RELACIONADOS

Bibliografía

F. Hayashi, *Econometrics*, Princeton University Press, 2000 (main text).

J. Angrist and J.-S. Pischke, *Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion*, Princeton University Press, 2009.

C. Gourieroux and A. Monfort, *Statistics and Econometric Models*, vol. 1 and 2, Cambridge University Press, 1995.

J. D. Hamilton, *Time Series Analysis*, Princeton University Press, 1994.

J. Stock and M. Watson, *Introduction to Econometrics*, Pearson Education, 2nd edition, 2007.

J. Wooldridge, *Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data*, MIT Press, 2010.