Econometrics

MASTER'S DEGREE IN ECONOMICS AND FINANCE

UNIVERSIDAD INTERNACIONAL MENÉNDEZ PELAYO

Másteres Universitarios

This document can be used as reference documentation of this subject for the application for recognition of credits in other study programmes. For its full effect, it should be stamped by UIMP Student's Office.

GENERAL DATA

Name

Econometrics

Code

102666

Academic year

2022-23

Degree

MASTER'S DEGREE IN ECONOMICS AND FINANCE

ECTS Credits

6

Type

MANDATORY

Duration

Cuatrimestral

Language

English

CONTENTS

Contents

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

COMPETENCES

General competences

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.
G5 - Diseñar y llevar a cabo un proyecto de investigación con un alto nivel académico, formulando hipótesis razonables, en el área de la economía.
G6 - Presentar oralmente trabajos científicos y técnicos en economía, a públicos especializados y no especializados, de un modo claro y sin ambigüedades.
G7 - Elaborar adecuadamente composiciones escritas y redactar proyectos de trabajo o artículos científicos.
G8 - Organizar y planificar su propio trabajo, fomentando la iniciativa y el espíritu emprendedor.
G9 - Integrarse en grupos de trabajo dedicados a proyectos de investigación económica.
G10 - Demostrar capacidad de estudio, síntesis y autonomía suficientes para, una vez finalizado el Máster, llevar a cabo una tesis doctoral en el área de la economía.

Specific competences

EO7 - Conocer las teorías y los modelos avanzados de la Macroeconomía moderna.
ET2 - Conocer en profundidad el comportamiento de los agentes microeconómicos fundamentales, consumidores y productores, y los principales resultados de la teoría del equilibrio general competitivo. Poseer conocimientos básicos de la teoría de juegos con información completa.
ET3 - Conocer los principales modelos de la moderna economía de la información, a partir del análisis de la elección en condiciones de incertidumbre y de la teoría de juegos con información incompleta.
ET4 - Contar con conocimientos básicos de macroeconomía a través del análisis de la estructura y las implicaciones de los principales modelos de referencia.
ET5 - Contar con los conocimientos estadísticos necesarios para poder seguir los cursos de econometría y los temas con contenido estadístico de los otros cursos del Máster, en lo relativo a los conceptos básicos de la teoría de la probabilidad, inferencia y teoría asintótica, con especial referencia a los modelos de regresión.
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.

LEARNING PLAN

Training activities

Denominación	Número de horas	% Presencialidad
Clases teóricas	30	100
Clases prácticas	17,5	100
Estudio del contenido teórico del curso	50	0
Resolución de ejercicios prácticos	33,3	0
Preparación de presentaciones en clase	19,1	40

Teaching methods

Clases teóricas
Ejercicios
Elaboración de ensayos
Discusión en clase de trabajos presentados por los alumnos

Learning outcomes

- Conocer de forma rigurosa y completa los principales métodos matemáticos empleados en economía.
- Conocer en profundidad el comportamiento de los agentes microeconómicos fundamentales, consumidores y productores, y los principales resultados de la teoría del equilibrio general competitivo. Poseer conocimientos básicos de la teoría de juegos con información completa.
- Conocer los principales modelos de la moderna economía de la información, a partir del análisis de la elección en condiciones de incertidumbre y de la teoría de juegos con información incompleta.
- Contar con conocimientos básicos de macroeconomía a través del análisis de la estructura y las implicaciones de los principales modelos de referencia.
- Contar con los conocimientos estadísticos necesarios para poder seguir los cursos de econometría y los temas con contenido estadístico de los otros cursos del Máster, en lo relativo a los conceptos básicos de la teoría de la probabilidad, inferencia y teoría asintótica, con especial referencia a los modelos de regresión.
- Conocer los principales modelos y métodos de estimación e inferencia usados en la econometría, para datos tanto de series temporales como de corte transversal y de panel.

EVALUATION

Evaluation system

Denominación	Ponderación mínima	Ponderación máxima
Ejercicios	0.05	0.3
Presentaciones	0.05	0.15
Exámenes	0.7	0.95

FACULTY

Coordinator/s

Arellano González, Manuel

Doctor en Economía, London School of Economics
Profesor de Econometría
Centro de Estudios Monetarios y Financieros (CEMFI)

Lecturers

Redondo Ramos, Isabel

Coordinadora Académica
Centro de Estudios Monetarios y Financieros (CEMFI)