

ADMINISTRACIÓN Y DIRECCIÓN DE EMPRESAS

A.D.E.

Departamento de Análisis Económico

Econometría Empresarial II

Curso 2006-2007

Materia: Troncal

Ubicación: Segundo Ciclo

4º curso 2º semestre

Créditos: 4'5

Profesores/as: Víctor Barrios Pérez

Bernardí Cabrer Borrás (Coordinador)

Paz Rico Belda

PROGRAMA DE ECONOMETRÍA II

A.D.E.

Curso 2006/2007

El programa de esta asignatura está concebido para complementar y ampliar las nociones obtenidas en la asignatura Econometría Empresarial I. El objetivo que se plantea es que el alumno adquiera conocimientos suficientes para que sea capaz de efectuar e interpretar predicciones en el campo de la economía, y estudiar y aplicar algunas herramientas y modelos en el campo de la predicción y decisión.

La evaluación de esta asignatura se realizará el día del examen y constará de distintas preguntas, mediante las cuales se evaluarán los conocimientos adquiridos sobre la materia. Las preguntas del examen se inspirarán en las explicaciones teóricas y prácticas que el alumno deberá contestar. También se propondrán cuestiones teórico-prácticas similares a las propuestas en clase.

PARTE I
MICROECONOMETRÍA Y DECISIÓN

1. CONCEPTOS BÁSICOS.

- 1.1. Función de densidad y función de distribución.
- 1.2. Estimación máximo verosímil.
- 1.3. Medidas de bondad de los modelos.
- 1.4. Interpretación de los coeficientes de los modelos.
- 1.5. Práctica. El programa informático Econometric Views (*Eviews*).

2. LA ECONOMÍA Y DECISIÓN.

- 2.1. Procesos de decisión en economía.
- 2.2. Microeconometría.
- 2.3. Clasificación de los modelos microeconómicos.
- 2.4. Economía y modelos de elección discreta.
- 2.5. Práctica. Repaso de conceptos básicos.

3. MODELO LINEAL DE PROBABILIDAD.

- 3.1. Introducción.
- 3.2. Modelo Lineal de Probabilidad (MLP).
 - 3.2.1. Especificación.
 - 3.2.2. Limitaciones del modelo lineal cuando se estima por MCO.
 - 3.2.3. Interpretación de los coeficientes.
- 3.3. Modelo Lineal de Probabilidad ponderado o MLP estimado por Mínimos Cuadrados Generalizados (MCG): sus limitaciones.
- 3.4. Práctica. El Modelo Lineal de Probabilidad (MLP).

4. MODELOS LOGIT Y PROBIT (I).

4.1. Introducción.

4.2. Modelo Logit.

4.2.1. Especificación.

4.2.2. Interpretación del modelo Logit.

4.3. Modelo Probit.

4.3.1. Especificación.

4.3.2. Interpretación del modelo Probit.

4.4. Práctica. Modelos Logit y Probit (I).

5. MODELOS LOGIT Y PROBIT (II).

5.1. Estimación Máximo Verosímil (MV).

5.2. Validación y contraste de hipótesis.

5.3. Práctica. Modelos Logit y Probit (II).

6. MODELOS DE RESPUESTA MÚLTIPLE.

6.1. Introducción.

6.2. Modelos de respuesta múltiple ordenado: especificación.

6.3. Interpretación del modelo ordenado.

6.4. Estimación Máximo Verosímil.

6.5. Práctica. Estimación de modelos de respuesta múltiple.

PARTE II
ECONOMETRÍA Y PREDICCIÓN

7. INTRODUCCIÓN

- 7.1. Predicción y series temporales.
- 7.2. Concepto de serie temporal.
- 7.3. Componentes no observables de una serie temporal.
- 7.4. Práctica. Análisis descriptivo de una serie: Representación gráfica de la serie original, representación gráfica de la serie transformada (logaritmos, diferenciada), test de normalidad, función de autocorrelación

8. MODELOS LINEALES SIN ESTACIONALIDAD (I).

- 8.1. Modelos autorregresivos (AR): especificación, hipótesis y su caracterización.
- 8.2. Modelos de medias móviles (MA): especificación, hipótesis y su caracterización.
- 8.3. Modelos mixtos autorregresivos y de medias móviles (ARMA). especificación, hipótesis y caracterización.
- 8.4. Modelos mixtos integrados autorregresivos y de medias móviles (ARIMA) Especificación, hipótesis y su caracterización.
- 8.5. Práctica. Estudio del correlograma.

9. MODELOS LINEALES SIN ESTACIONALIDAD (II).

- 9.1. Identificación de una serie temporal.
- 9.2. Estimación de un modelo de serie temporal.
- 9.3. Validación de un modelo de series temporales.
- 9.4. Práctica: Identificación, estimación y validación de un modelo de series temporales.

10. MODELOS LINEALES CON ESTACIONALIDAD

- 10.1. Modelos ARIMA: especificación, hipótesis y su caracterización.
- 10.2. Identificación, estimación y validación..
- 10.3. Práctica: Identificación, estimación y validación de un modelo de series temporales.

11. HACIA LA MODELIZACIÓN AUTOMÁTICA DE UNA SERIE TEMPORAL:

- 11.1 Identificación de una serie temporal mediante TRAMO. Estacionariedad, estacionalidad, efectos calendario, efecto pascua, estudio de los valores atípicos (outliers).
- 11.2. Estimación y validación del modelo (análisis de los residuos, contraste de la estabilidad / invertibilidad, significatividad,)
- 11.3. Práctica. Identificación, estimación y predicción con un modelo de serie temporal.

Bibliografía básica de la primera parte:

- Cabrer B., Sancho a. y Serrano G. (2001): Microeconometría y decisión. Ed. Pirámide. Madrid.
- Greene W.H.(1998) Análisis econométrico (3ª edición) Prentice Hall. Madrid.

Bibliografía básica de la segunda parte:

- Cabrer B. Apuntes sobre series temporales en la página WEB <http://www.uv.es/~cabrer/>
- Uriel E. et al. (2000): Análisis de series temporales. Modelo ARIMA. Ed. AC. Madrid

Bibliografía complementaria:

- Aznar A. y Trivez F.J. (1993): Métodos de Predicción en Economía. Ed. Ariel.
- Evans, M.K. (2002) Practical Business Forecasting Ed.Blackwell. Oxford UK
- Gujarati D.N. (1997): Econometría (3ª edición). Ed. McGraw-Hill. Madrid.
- Johnston J. Y Dinardo J. (2001) Métodos de Econometría Edit Vicens Vives Barcelona
- Maddala G.S. (1985): Econometría. Ed. McGraw-Hill. Madrid.
- Maravall A. Y Gomez V.(1996) Programa TRAMO and SEATS. Instructions for the user Documento de trabajo 9628. Banco de España. Madrid.
- Novales A. (1993): Econometría. Ed. McGraw-Hill. Madrid.
- Otero J.M. (1993): Econometría. Series temporales y Predicción. Ed. AC. Madrid.
- Pindyck R.S. y Rubinfeld D. (1986): Modelos Económicos. Ed. Labor. Barcelona.
- Pena Trapero B. et al. (2000): Cien problemas de econometría. Ed. Pirámide. Madrid.
- Pulido A. Y López A. (1999): Predicción y simulación aplicada a la economía y gestión de empresas. Ed. Pirámide. Madrid.