

# 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

### Título asignatura

Econometría

### Código asignatura

102666

### Curso académico

2023-24

### Planes donde se imparte

[MÁSTER UNIVERSITARIO EN ECONOMÍA Y FINANZAS](#)

### Créditos ECTS

6

### Carácter de la asignatura

OBLIGATORIA

### Duración

Cuatrimestral

### Idioma

Inglés

# CONTENIDOS

## Contenidos

Esta asignatura presenta los principales modelos y métodos de estimación e inferencia utilizados en econometría, tanto para series temporales como para datos de panel y datos transversales.

Para más información: [cemfi.es](http://cemfi.es)

# 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.
- 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.

## Específicas

- 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.

## PLAN DE APRENDIZAJE

### Actividades formativas

Denominación	Número de horas	% Presencialidad
Clases teóricas		100
Clases prácticas		100
Estudio del contenido teórico del curso		0
Resolución de ejercicios prácticos		0
Preparación de presentaciones en clase		40

### Metodologías docentes

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

### Resultados de aprendizaje

- 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.

# SISTEMA DE EVALUACIÓN

## Descripción del sistema de evaluación

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

## Calendario de exámenes

- Calendario de exámenes

## 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**

Lunes (9:30 &#8211; 11:00), Miércoles (9:30 &#8211; 11:00 y 11:30 &#8211; 13:00)



# BIBLIOGRAFÍA Y ENLACES RELACIONADOS

## Bibliografía

### Bibliografía básica

- Bruce Hansen, Econometrics <https://www.ssc.wisc.edu/~bhansen/econometrics/>
- J. Angrist and J.-S. Pischke, Mostly Harmless Econometrics, Princeton University Press, 2009.
- C. Cameron and P. Trivedi, Microeconometrics, Cambridge University Press, 2005
- C. Gourieroux and A. Monfort, Statistics and Econometric Models, Cambridge U.P., 1995.
- J. D. Hamilton, Time Series Analysis, Princeton University Press, 1994.
- F. Hayashi, Econometrics, Princeton University Press, 2000.
- 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.