



**FACULTAD DE CIENCIAS  
ECONÓMICAS Y  
EMPRESARIALES  
BADAJOZ  
CURSO 07-08**



**ASIGNATURA:**

**ECONOMETRÍA II**

**Titulación:**

**Licenciatura en Economía**

**Curso:**

**Temporalidad:**

**Créditos:**

**Totales Teóricos Prácticos**

<b>Cuarto</b>	<b>Cuatrimestral (1º)</b>	<b>4,5</b>	<b>3</b>	<b>1,5</b>
---------------	---------------------------	------------	----------	------------

**Profesorado:**

**Apellidos, Nombre:**

**Página Web**

**Ramajo Hernández, Julián**

<http://eco.unex.es/jramajo/>

**Departamento:**

**Página Web**

**Economía Aplicada y Organización de Empresas**

<http://eco.unex.es/decapoe/>

**Área:**

**Página Web**

**Métodos cuantitativos para la economía y la empresa**

--

**Objetivos:**

**a) Objetivo principal:** ser capaz de realizar un análisis econométrico riguroso con los métodos estudiados en cada uno de los temas, siendo capaz de especificar el modelo correspondiente, de contrastar las hipótesis estadísticas más relevantes y de interpretar los resultados obtenidos desde el punto de vista econométrico y de la teoría económica.



**FACULTAD DE CIENCIAS  
ECONÓMICAS Y  
EMPRESARIALES  
BADAJOZ  
CURSO 07-08**



**b) Objetivos secundarios:**

-Ser capaz de diferenciar cuando es necesario la utilización de cada uno de los modelos estudiados en cada tema.

-Ser capaz de comprender, interpretar y evaluar críticamente los análisis empíricos en los que intervengan dichos modelos.

-Ser capaz de estimar eficientemente los modelos estudiados en este bloque mediante el software econométrico apropiado (EViews y LimDep).

**Temario:**

**1. Modelos econométricos para datos no estacionarios. Teoría de la cointegración.**

- 1.1. Introducción: no estacionariedad y regresiones espurias.
- 1.2. Procesos estocásticos estacionarios y no estacionarios.
- 1.3. Contrastes de raíces unitarias.
- 1.4. Variables no estacionarias en el modelo de regresión clásico. Regresiones espurias.
- 1.5. Cointegración.
- 1.6. Estimación de las relaciones de cointegración (largo plazo).
- 1.7. Estimación de las relaciones dinámicas a corto plazo.
- 1.8. Aplicaciones.

**2. Modelos econométricos para datos de panel**

- 2.1. Datos de panel y efectos inobservables (individuales y temporales).
- 2.2. Resultados preliminares.
- 2.3. Modelos estáticos: estimadores alternativos y comparación de métodos.
- 2.4. Modelos dinámicos.
- 2.5. Aplicaciones.

**3. Modelos econométricos para datos de corte transversal especiales**

- 3.1. Datos discretos: los modelos Probit y Logit.
- 3.2. Censura y truncamiento: consideraciones generales.
- 3.3. Datos truncados: el modelo de regresión con Truncamiento.
- 3.4. Datos censurados: el modelo Tobit.
- 3.5. Datos con truncamiento selectivo (selección muestral): el modelo Heckit.
- 3.6. Aplicaciones.

**Bibliografía:**

Básica:

- Wooldridge J.M. (2006), **Introducción a la econometría: Un enfoque moderno,**



# FACULTAD DE CIENCIAS ECONÓMICAS Y EMPRESARIALES BADAJOZ CURSO 07-08



## **Segunda Edición, Thomson Paraninfo.**

- Greene W. (1999), Análisis econométrico, Tercera Edición, Prentice-Hall.
- Johnston J. y Dinardo J. (2001), Métodos de Econometría, Vicens Vives.

## Complementaria:

- Tema 1: Banerjee A. et al. (1993), Co-integration, error-correction, and the econometric analysis of non-stationary data, Oxford University Press.
- Tema 2: Baltagi B. (1995), Econometric Analysis of Panel Data, Wiley.
- Tema 3: Maddala G.S. (1983), Limited-dependent and qualitative variables in econometrics, Cambridge University Press. Gourieroux C. (2000), Econometrics of Qualitative Dependent Variables, Cambridge University Press. Cabrer B. et al. (2001), Microeconometría y decisión, Ediciones Pirámide.

## **Enlaces:**

Toda la documentación sobre el curso (notas de clase, ejercicios y material complementario) se encuentra disponible en la página web <http://eco.unex.es/jramajo/ec2.htm>

## **Criterios de evaluación:**

- Para superar la asignatura, es requisito necesario que el alumno supere un examen final que recogerá cuestiones tanto teóricas como prácticas relativas a los diferentes temas del programa.
- En el examen el alumno no debe mostrar un claro desconocimiento de algunos de los temas planteados. En otras palabras, si un alumno obtiene en algún ejercicio una puntuación que refleja un claro desconocimiento de dicho tema, el alumno no superará la asignatura.
- **La asistencia con participación activa a las clases y prácticas se valorará positivamente.**

## Normas para la realización del examen:

El examen consistirá en una prueba teórico-práctica que versará sobre aplicaciones econométricas concretas. A partir de las salidas de ordenador se plantearán cuestiones que deberán contestarse. Normalmente se requerirá hacer cálculos, por lo que deberán presentarse los mismos en la hoja del examen ya que en otro caso se podrá invalidar dicha respuesta. Las cuestiones planteadas sobre cada ejercicio tendrán asignada una puntuación que se indicará al comienzo de la misma. Para que las respuestas se consideren correctas, deberá figurar de modo explícito en la hoja del examen cada una de las hipótesis que se contrasta, así con el tipo de test o cálculo realizado.

El tiempo para la realización del examen será, en general, de dos horas y media.



**FACULTAD DE CIENCIAS  
ECONÓMICAS Y  
EMPRESARIALES  
BADAJOZ  
CURSO 07-08**



**Tutorías:**

<b>Despacho:</b>	<b>1<sup>er</sup> Cuatrimestre:</b>	<b>2<sup>o</sup> Cuatrimestre:</b>
Despacho nº 50 del Edificio de Departamentos	Lunes (12h a 14h30), Martes (11h a 14h30, 18 h a 19 h)	Lunes (12h a 14h30), Martes (11h a 14h30)

**Observaciones:**

Como complemento a las tutorías personalizadas, puede utilizarse el correo electrónico del profesor ([ramajo@unex.es](mailto:ramajo@unex.es)) para plantear cuestiones sobre la asignatura.