

Assignatura: **ECONOMETRIA II**

Codi: **16022005** Crèdits: **6**

Tipus: **Troncal** Cicle: **2n** Curs: **3r** Quadrimestre: **2n**

Departament: **Economia**

Àrea: **Economia Aplicada**

Professorat: **Miquel Manjón, Sònia Toro**

Objetius generals:

Este curso pretende proporcionar conocimientos sobre ciertas extensiones del modelo de regresión lineal relacionadas con la dimensión temporal de la actividad económica y la toma de decisiones por parte de un agente (individuo, empresa, etc.). El curso está orientado hacia la modelización econométrica de problemas micro y macroeconómicos.

Criteris d'avaluació:

- Un examen del conjunto de conocimientos de la asignatura llevado a cabo al finalizar el curso. Su ponderación en la evaluación final será del 80% (100% si no se llevan a cabo TODAS las pruebas de evaluación continuada propuestas a lo largo del curso).
 - Una prueba parcial al finalizar cada tema (4 pruebas en total). Su ponderación en la evaluación final será del 20% (0% si no se llevan a cabo TODAS las pruebas).
-

Assignatures que es recomana haver cursat prèviament/simultàniament:

Estadística I

Estadística II

Econometria I

Anàlisi Matemàtica I

Assignatures en les quals s'apliquen els continguts d'aquesta:

Política Econòmica

Economia Laboral

Economia Catalana

Economia Internacional i Integració Econòmica

Bibliografia bàsica:

Gujarati, D.N. *Econometria*. McGraw-Hill, 2004.

Johston, J.; Dinardo, J. *Métodos de econometria*. Vicens Vives, 2001.

Novales, A. *Econometria*. McGraw-Hill, 1993.

Uriel, E.; Peiró, A. *Introducción al análisis de series temporales*. AC, 2000.

Bibliografia complementària:

Baltagi, B.H. *Econometrics*. Springer-Verlag, 1999.

Green, W.G. *Análisis Económico*. Ed. Prentice Hall, 2000.

Programa:

1. Series Temporales.

- 1.1 Procesos estocásticos: definiciones.
- 1.2 Modelos lineales en procesos estocásticos estacionarios y ergódicos: autorregresivos, medias móviles y mixtos (ARMA).
- 1.3 Identificación, estimación, diagnosis y predicción: la metodología Box-Jenkins.
- 1.4 Raíces unitarias, cointegración y modelos de corrección del error.

Gujarati (2004: cap. 21-22); Johston-Dinardo (2001: cap. 7, 9); Novales (1993: cap. 13-14); Uriel-Peiró (2000: cap.1-7, 10). Baltagi (1999: cap. 14); Green (2000: cap. 18).

2. Modelos dinámicos uniecuacionales.

- 2.1 La introducción de dinámica en los modelos de regresión.
- 2.2 Modelos con retardos distribuidos.
- 2.3 Formulaciones alternativas: Expectativas Adaptables y Ajuste Parcial.
- 2.4 Estimación de modelos con retardos finitos.
- 2.5 Estimación de modelos autorregresivos.

Gujarati (2004: cap. 17); Johston-Dinardo (2001: cap. 8); Novales (1993: cap. 9); Uriel-Peiró (2000: cap.11). Baltagi (1999: cap. 6); Green (2000: cap. 17).

3. Modelos de elección discreta.

- 3.1 El modelo lineal de probabilidad.
- 3.2 Modelos Logit y Probit.
- 3.3 Inferencia en modelos de elección discreta.

Gujarati (2004: cap. 15-16); Johston-Dinardo (2001: cap. 13); Novales (1993: cap. 16). Baltagi (1999: cap. 13); Green (2000: cap. 16).

4. Modelos de ecuaciones simultáneas.

- 4.1 Modelos multiecuacionales.
- 4.2 Forma estructural y forma reducida.
- 4.3 El problema de la identificación.
- 4.4 Métodos de estimación.

Gujarati (2004: cap.18-20); Johston-Dinardo (2001: cap. 9); Novales (1993: cap. 17-18). Baltagi (1999: cap. 11); Green (2000: cap. 19).