

Assignatura: **ECONOMETRIA II**

Codi: **16062018** Crèdits: **6**

Tipus: **Troncal** Cicle: **2n** Curs: **3r** Quadrimestre: **1r**

Departament: **Economia**

Àrea: **Economia Aplicada**

Professorat: **O. Martinez y S. 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 el análisis de los resultados obtenidos (con el apropiado software) en la modelización econométrica de problemas micro y macroeconómicos. Al finalizar el curso el alumno/a deberá estar familiarizado con los conceptos de dinámica, identificación, máxima verosimilitud y proceso estocástico y ser capaz de distinguir entre variables instrumentales, endógenas, predeterminadas y exógenas.

Criteris d'avaluació:

La evaluación se llevará a cabo a partir de los resultados obtenidos en dos tipos de pruebas: i) unas de carácter parcial y voluntario al finalizar cada tema del programa de la asignatura; y ii) un examen general y obligatorio al finalizar el curso. Si no se llevan a cabo las pruebas parciales la nota final será la del examen; de realizarse, estos parciales representarán un máximo de un 20% de la nota final (5% por cada parcial). Tanto el examen como las pruebas parciales estarán basados en los ejercicios realizados durante las clases (teóricas y prácticas), pero siempre se llevarán a cabo en el aula de informática empleando software y bases de datos apropiados. No obstante, mientras que las pruebas parciales tendrán un formato tipo test con respuesta múltiple, el examen constará de varios problemas con cuestiones organizadas en apartados (siguiendo la pauta de las prácticas realizadas a lo largo del curso). En el examen se permitirá la utilización de un formulario elaborado por el propio alumno con los contenidos que considere necesario, incluyendo tanto conceptos de carácter teórico como notas sobre la forma de solucionar los ejercicios propuestos. Este formulario deberá estar realizado en un máximo de cuatro hojas tamaño DIN-A4. En las pruebas parciales también se permitirá utilizar un formulario análogo, si bien se limitará su extensión a una sola hoja tamaño DIN-A4 (que luego podrá formar parte del formulario empleado en el examen).

Assignatures que es recomana haver cursat prèviament/simultàniament:

Anàlisi Matemàtica I y II, Estadística I y II, Econometría I, Macroeconomía I y II, Microeconomía I y II.

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

Política Económica, Política Industrial, Economía Catalana, Economía Laboral

Bibliografia bàsica:

Gujarati, D.N. (1997): *Econometría*, Ed. McGraw-Hill, Mexico.

Johston, J. y Dinardo, J. (2001): *Métodos de econometría*, Ed. Vicens Vives.

Novales, A. (1993): *Econometría*, Ed. McGraw-Hill, Madrid.

Uriel, E. y Peiró, A. (2000): *Introducción al análisis de series temporales*, Ed. AC.

Bibliografia complementària:

Baltagi, B.H. (1999): *Econometrics*, Springer-Verlag.

Green, W.G. (2000): *Análisis Económico*, Prentice Hall.

Programa:

- 1. Series temporales univariantes (Predicción)**
 - 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 y diagnosis: la metodología Box-Jenkins. Predicción.
- 2. Series temporales multivariantes (Regresión)**
 - 2.1. Modelos dinámicos con variables estacionarias.
 - 2.1.1. Modelos con retardos distribuidos.
 - 2.1.2. Formulaciones alternativas: Expectativas Adaptables y Ajuste Parcial.
 - 2.1.3. Estimación de modelos con retardos finitos.
 - 2.1.4. Estimación de modelos autorregresivos.
 - 2.2. Modelos de regresión con variables no estacionarias.
 - 2.2.1. Regresión espúria.
 - 2.2.2. Cointegración.
 - 2.2.3. El Modelo de Corrección del Error.
- 3. Modelos de elección discreta**
 - 3.1. El modelo lineal de probabilidad.
 - 3.2. Estimación máximo verosímili: el modelo lineal.
 - 3.3. Modelos Logit y Probit.
 - 3.4. Inferencia en modelos de elección discreta.
 - 3.5. Elección múltiple.
- 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.