

Assignatura: **Econometria II**

Codi: **16062018** Crèdits: **6**

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

Departament: **Economia**

Àrea: **Economia Aplicada**

Professorat: **Óscar Martínez**

---

#### **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:**

El examen de la asignatura estará basado en los ejercicios realizados durante las clases (teóricas y prácticas). 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. Además, también podrán emplearse las copias de los correlogramas teóricos y los esquemas sobre detección de raíces unitarias proporcionadas durante el curso. Si no se llevan a cabo los parciales propuestos al finalizar cada tema, 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).

El curso está organizado en clases teóricas y prácticas. Las primeras tienen carácter magistral y se desarrollarán sobre las notas que se proporcionan al alumno. Estas notas tienen un carácter orientativo y deben complementarse con las lecturas recomendadas. Las clases prácticas se realizarán en un aula de informática empleando diversas bases de datos y consistirán esencialmente en la resolución de enunciados que reflejen sencillos problemas técnicos y/o económicos. Los resultados numéricos se obtendrán empleando software adecuado.

---

#### **Assignatures que es recomana haver cursat prèviament/simultàniament:**

Econometría I

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

---

**Bibliografía 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

**Bibliografía complementària:**

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

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

## **Programa:**

### Tema 1. Series Temporales univariantes.

- 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 diagnóstico: la metodología Box-Jenkins.
- 1.4 Predicción.
- 1.5 Procesos no estacionarios: Procesos Integrados y Raíces unitarias.

### Tema 2. Series Temporales multivariantes.

- 2.1 Modelos dinámicos para series 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 para series no estacionarias
  - 2.2.1 Regresión espuria
  - 2.2.2 Cointegración y modelo de corrección del error.

### Tema 3. Modelos de ecuaciones simultáneas.

- 3.1 Modelos multiecuacionales.
- 3.2 Forma estructural y forma reducida.
- 3.3 El problema de la identificación.
- 3.4 Métodos de estimación.
- 3.5 Apendice: Modelos VAR.

### Tema 4. Modelos de elección discreta.

- 4.1 El modelo lineal de probabilidad.
- 4.2 Modelos Logit y Probit.
- 4.3 Inferencia en modelos de elección discreta.
- 4.4 Elección múltiple.