

Assignatura-Codi

MÉTODOS ECONOMÉTRICOS	22287
-----------------------	-------

Curs acadèmic	Cicle	Quadrimestre
1997/98	2	febrero-junio

Grup/s	Professors	Despatx	Telèfon Despatx
51	Víctor Manuel Montuenga Gómez	B3-112-E	581 18 11
51	Andrés Romeu Santana	B3-112-E	581 18 11

PROGRAMA

DESCRIPTOR OFICIAL DE L'ASSIGNATURA

Modelos Económicos es la continuación natural de la asignatura de Introducción a la Econometría. En conjunto proporcionan la base teórica para la aplicación de técnicas que permiten la evaluación empírica de los hechos económicos.

OBJECTIUS DE L'ASSIGNATURA

Una vez estudiado el modelo lineal general en base a los supuestos clásicos, se analiza la utilización de dicho modelo lineal general cuando se relajan tales supuestos. Adicionalmente, se estudian diversas extensiones del modelo.

PRERREQUISITOS

Parte de los temas están relacionados con los asignaturas de Introducción a la Econometría y Estadística (es pressuposa que l'alumne/a ha cursat ja els dos quadrimestres).

METODOLOGÍA

Se combinarán las clases magistrales, apoyadas con transparencias, con la realización de tareas prácticas. En ambos casos la intervención del alumno será recomendada e incentivada.

TEMARI DETALLAT DELS CONTINGUTS

O. PRESENTACIÓN Y REPASO

1. Modelo Lineal general.

1. TÓPICOS DEL MODELO LINEAL GENERAL (MLG).

1. Variables ficticias
2. Estacionalidad
3. Mínimos cuadrados restringidos (MCR).
4. Mínimos cuadrados no lineales (MCNL).

2. RELAJACIÓN DE LOS SUPUESTOS CLÁSICOS DEL MLG.

1. Multicolinealidad.
2. Errores de especificación.
3. Mínimos cuadrados generalizados (MCG).
 - 3a. Autocorrelación.
 - 3b. Heterocedasticidad.
4. Exogeneidad (contraste de Hausman).
5. Normalidad (contraste de Jarque-Bera).

3. EXTENSIONES DEL MODELO LINEAL GENERAL.

1. Sistemas de ecuaciones.
2. Selección de modelos.
 - 2a. Modelos anidados y no anidados.
 - 2b. Contraste RESET de Ramsey.
3. Errores de medición.
4. Variables de elección discreta.
5. Teoría asintótica.

4. MODELOS DINÁMICOS.

1. Justificación económica.
2. Retardos de las variables exógenas.
3. Retardos de las variables endógenas.

5. MODELOS SIMULTÁNEOS.

1. Concepto.
2. Identificación.
3. Estimación..
4. Variables instrumentales.

BIBLIOGRAFIA BÀSICA

- Novales, A. (1993), "Econometría", 2ª Edición, Edit McGraw-Hill
- Johnston, J. (1987), "Métodos de la Econometría", Edit. Vicens Vives.

NORMES D'EXAMEN I AVALUACIONS

El elemento principal en la valoración del trabajo del alumno será el examen final. Aunque pueden añadirse actividades adicionales.

HORES TUTORIES

PROFESSOR	HORARI TUTORIES
Víctor M. Montuenga Gómez	
Andrés Romeu Santana.	