

UNIVERSIDADE DE SANTIAGO DE COMPOSTELA

FACULDADE DE CIENCIAS ECONÓMICAS E EMPRESARIAIS

DEPARTAMENTO DE ECONOMÍA CUANTITATIVA

Programa da materia

MÉTODOS ECONOMÉTRICOS (AMPLIACIÓN)

***5º Curso da Licenciatura de Economía
(Especialidade de Análise Económica)***

Curso 2008-2009

Profesores:

M^a Carmen López Andión
Xosé Antón Rodríguez González

MÉTODOS ECONOMÉTRICOS (AMPLIACIÓN): Asignatura optativa do quinto curso da Licenciatura en Economía (especialidade de Análise Económica)

NÚMERO DE CRÉDITOS: 6

DEPARTAMENTO: Métodos Cuantitativos para a Economía e a Empresa.

OBXECTIVOS:

Sobre a base dos coñecementos na materia de Econometría adquiridos polo alumno previamente, abórdase a profundización en contidos xa introducidos e a ampliación de coñecementos en aspectos mais novedosos e recentes no campo da metodoloxía econométrica.

CRITERIOS DE AVALIACIÓN:

O profesor efectuará unha avaliación global na que se terá en conta a asistencia e participación nas clases teóricas e prácticas, e a superación dun exame correspondente á materia impartida.

PROGRAMA

Tema 1.- *Modelos con regresores estocásticos.*

- 1.1. Introducción: consistencia dos estimadores MCO.
- 1.2. Erros de medida nas variables.
- 1.3. O método das variables instrumentais.

Tema 2.- *Modelos de ecuacións simultáneas.*

- 2.1. Introducción.
- 2.2. Métodos de estimación.
- 2.3. Análise da identificación.
- 2.4. Predicción e avaliación.
- 2.5. Aspectos dinámicos.

Tema 3.- *Outros modelos multiecuacionais.*

- 3.1. Modelos recursivos.
- 3.2. Sistemas de ecuacións aparentemente non relacionadas.
- 3.3. Modelos de vectores autorregresivos.

Tema 4.- *Combinación de datos temporais e atemporais.*

- 4.1. Plantexamento xeral.
- 4.2. Contrastes de estabilidade.
- 4.3. Estimación baixo as diferentes estruturas da matriz de varianzas-covarianzas das perturbacións.
- 4.4. Efectos fixos e aleatorios: procedementos de estimación.

Tema 5.- *Análise da cointegración.*

- 5.1. Introducción.
- 5.2. Contrastes de raíces unitarias.
- 5.3. Concepto de cointegración.
- 5.4. Contrastes de cointegración.
- 5.5. Modelización de series cointegradas mediante os modelos de corrección do erro.

Tema 6.- *Verificación e selección de modelos.*

- 6.1. Os métodos tradicionais.
- 6.2. Modelos anidados e non anidados: criterios de selección.
- 6.3. Tests de residuos.
- 6.4. Tests de estabilidade estrutural.
- 6.5. Análise da causalidade.

Tema 7.- *Problemas especiais en Econometría.*

- 7.1. Modelos non lineais.
- 7.2. Variables dependentes cualitativas e limitadas.

Tema 8.- *Aplicacións informáticas.*

Bibliografía básica

- Greene, W.** (1999): *Análisis econométrico*. Madrid: Prentice-Hall Iberia.
- Gujarati, D.** (2003): *Econometría*. México: McGraw-Hill.
- Novales, A.** (1993): *Econometría*. Madrid: McGraw-Hill.
- Otero, J. M.** (1993): *Econometría. Series temporales y predicción*. Madrid: AC.
- Pulido, A.** (1993): *Modelos econométricos*. Madrid: Pirámide.

Bibliografía complementaria

- Amemiya, T.** (1985): *Advanced Econometrics*. Cambridge: Harvard University Press.
- Anchuelo, A.** (1993): "Series integradas y cointegradas: Una introducción", *Revista de Economía Aplicada*, Vol. 1, pp. 151-163.
- Anderson, T. W.** (1971): *Statistical analysis of time series*. New York: John Wiley.
- Arellano, M.** (1992): "Introducción al análisis econométrico con datos de panel", *Documento de Trabajo*. Servicio de Estudios del Banco de España.
- Arellano, M.** (1993): "On the Testing of Correlated Effects with Panel Data", *Journal of Econometrics*.
- Arellano, M.; Bond, S.** (1991): "Some Tests of Specification for Panel Data: Monte Carlo Evidence and an Application to Employment Equations", *Review of Economic Studies*, 58, pp.277-297.
- Arellano, M.; Bover, O.** (1990): "La Econometría de los Datos de Panel", *Investigaciones Económicas*, XIV, pp. 3-45.

- Aznar, A.** (1989): *Econometric model selection: A new Approach*. London: Kluwer Academic Publishers.
- Aznar, A.; Trávez, F. J.** (1993): *Métodos de predicción en Economía I*. Barcelona: Ariel. (Economía).
- Aznar, A.; Trávez, F. J.** (1993): *Métodos de predicción en Economía II. Análisis de series temporales*. Barcelona: Ariel. (Economía).
- Ben-Akiva M.; Lerman, S. R.** (1989): *Discrete choice analysis: Theory and applications to travel demand*. The MIT Press.
- Berndt, E. R.** (1990): *The practice of econometric classic and contemporary*. Reading, Addison-Wesley.
- Box, G. E. P.; Jenkins, G. M.** (1976): *Time series analysis: forecasting and control*. San Francisco: Holden-Day.
- Charemza, W. W.; Deadman, D. F.** (1997): *New Directions in econometric practice*. Aldershot: Edward Elgar.
- Chow, G. C.** (1983): *Econometrics*. New York: McGraw-Hill.
- Darnell, A.; Evans, L.** (1990): *The limits of Econometrics*. Hampshire: Edward Elgar.
- Davidson, R.; Mackinnon, J.** (1993): *Estimation and inference in Econometrics*. New York: Oxford University Press.
- Deaton, A.** (1985): "Panel Data from Time Series of Cross-Section", *Journal of Econometrics*, 30, pp. 109-126.
- Dickey, D. A.; Fuller, W. A.** (1979): "Distribution of the Estimators for Autoregressive Time Series with a Unit Root", *Journal of the American Statistical Association*, Vol. 74, N. 366, pp. 427-431.
- Dolado, J. J.** (1983): "Contrastación de hipótesis no anidadas en el caso de la demanda de dinero en España", *Cuadernos Económicos de ICE*, 24, pp. 119-139.
- Dolado, J. J.** (1990): "Cointegración: una Panorámica", *Estadística Española*, 32, pp. 327-388.
- Dolado, J. J.; Jenkinson, T.; Sosvilla-Rivero, S.** (1990): "Cointegration and Unit Roots: A Survey", *Journal of Economic Surveys*.
- Draper, N.; Smith, A.** (1980): *Applied regression analysis*. New York: John Wiley.
- Enders, W.** (1995): *Applied Econometric Time Series*. New York: John Wiley & Sons.
- Engle, R. F.; Granger, C. W. J.** (1987): "Co-Integration and Error Correction: Representation, Estimation and Testing", *Econometrica*, Vol. 55, pp. 251-276.
- Engle, R. F.; Granger, C. W. J.** [ed.] (1991): *Log-run economic relationships. Readings in Cointegration*. New York: Oxford University Press.
- Engle, R. F.; Yoo, B. S.** (1987): "Forecasting and Testing in Cointegrated Systems", *Journal of Econometrics*, 35, pp. 143-159.
- Escribano, A.** (1990): "Introducción al Tema de Cointegración y Tendencias", *Cuadernos Económicos de ICE*, 44, pp. 7-42.

- Espasa, A.; Cancelo, J. R.** [ed.] (1993): *Métodos cuantitativos para el análisis de la coyuntura económica*. Madrid: Alianza.
- Fomby, T.; Hill, R.; Johnson, S.** (1984): *Advanced econometric methods*. New York: Springer-Verlag.
- Geweke, J.** (1984): "Inference and Causality in Economic Time Series Models", en Z. Griliches y M. D. Intriligator [ed.]: *Handbook of Econometrics*, Vol. II. Amsterdam: North-Holland.
- Ghosh, S. K.** (1991): *Econometrics. Theory and applications*. New Jersey: Prentice-Hall.
- Gill, P. E.; Murray, W.; Wright, M. H.** (1981): *Practical optimization*. New York: Academic Press.
- Godfrey, L. G.** (1988): *Misspecification tests in Econometrics*. New York: Cambridge University Press.
- Goldberger, A.** (1970): *Teoría econométrica*. Madrid: Tecnos.
- Goldberger, A.** (1991): *A course in Econometrics*. Cambridge: Harvard University Press.
- Gracia, M.** (1988): Modelos con variable dependiente cualitativa y de variación limitada", *Cuadernos Económicos de ICE*, 39, pp. 7-49.
- Granger, C. W. J.** (1990): *Modelling economic series*. Oxford University Press.
- Granger, C. W. J.; Newbold, P.** (1974): "Spurious Regressions in Econometrics", *Journal of Econometrics*, Vol. 2, pp. 111-120.
- Granger, C. W. J.; Newbold, P.** (1986): *Forecasting economic time series*. New York: Academic Press.
- Guisán, M. C.** (1999): "Causalidad y cointegración en modelos econométricos. Características, resultados y limitaciones". *Documentos de Econometría*, N. 17. Servicio de Publicaciones de la Universidad de Santiago de Compostela
- Hamilton, J. D.** (1994): *Time Series Analysis*. Princeton: Princeton University Press
- Harvey, A. C.** (1990): *The econometric analysis of time series*. Oxford: Philip Allan.
- Heckman, J.** (1978): "Dummy Endogenous Variables in a Simultaneous Equation System", *Econometrica*, Vol. 46, pp. 931-959.
- Hendry, D. F.; Pagan, A. R.; Sargan, J. D.** (1984): "Dynamic specification", en Griliches e Intriligator [comp.]: *Handbook of Econometrics*, Vol. II. Elsevier Science Publishers, B. V.
- Jenkins, G. M.; McLeod, G.** (1982): *Case studies in time series analysis*. GJP Publications, Lancaster.
- Johnston, J.** (1989): *Métodos de Econometría*. Barcelona: Vicens-Vives.
- Johnston, J.; DiNardo, J.** (1997): *Econometric methods*. Singapur: McGraw-Hill
- Judge, G.; Bock, M. E.** (1978): *The statistical implications of Pre-Test and Stein-Rule estimators in Econometrics*. Oxford: North-Holland.
- Judge, G. G.; Griffiths, W. E.; Hill, R. C.; Lee, T. C.** (1985): *The theory and practice of Econometrics*. New York: John Wiley and Sons.

- Judge, G. G.; Hill, R. C.; Griffiths, W. E.; Lutkepohe, H.; Lee, T. C.** (1982): *Introduction to the theory and practice of Econometrics*. New York: John Wiley.
- Kmenta, J.** (1980): *Elementos de econometría*. Barcelona: Vicens-Vives.
- Kennedy, P.** (1987): *A guide to Econometrics*. Oxford: Basil Blackwell.
- Leamer, E. E.** (1983): *Búsqueda de especificación: inferencia ad-hoc con datos experimentales*. Bilbao: Desclée de Brouwere.
- Lucas, R. E.** (1983): "Econometric Policy Evaluation: A Critique", *Theory, Policy, Institutions: Papers from the Carnegie-Rochester Conference Series on Public Policy*. North-Holland.
- Maddala, G. S.** (1981): "Model Selection", *Journal of Econometrics*, 16, pp. 1-170.
- Maddala, G. S.** (1983): *Limited dependent and qualitative variables in Econometrics*. New York: Cambridge University Press.
- Maddala, G. S.** (1985): *Econometría*. México: McGraw-Hill.
- Maddala, G. S.** (1993a): "Contrastes de especificación en modelos de variable dependiente limitada", *Cuadernos Económicos de ICE*, N. 55, pp. 185-224.
- Maddala, G. S.** [ed.] (1993b): *The Econometrics of panel data*. Vols. I y II. Aldershot: Edward Elgar.
- Maddala, G. S.** (1996): *Introducción a la Econometría*. México: Prentice Hall.
- Maddala, G. S.; Kim, I.** (1998): *Unit Roots, Cointegration and Structural Change*. Cambridge: Cambridge University Press.
- Malinvaud, E.** (1980): *Statistical methods of Econometrics*. Amsterdam: North-Holland.
- Nelson, C. R.** (1973): *Applied time series analysis for managerial forecasting*. San Francisco: Holden-Day.
- Pankratz, A.** (1983): *Forecasting with univariate Box-Jenkins models: concepts and cases*. New York: Academic Press.
- Peña, D.** (1987): *Estadística. Modelos y métodos. 2. Modelos lineales y series temporales*. Madrid: Alianza.
- Pesaran, M. H.** (1990): "Econometrics", *The New Palgrave Econometrics*, pp. 1-34. The Mcmillan Press Ltd.
- Pesaran, M. H.** (1990): "Non-nested Hypotheses", *The New Palgrave Econometrics*, pp. 167-173. The Mcmillan Press Ltd.
- Pindyck, R.; Rubinfeld, D.** (1980): *Modelos econométricos*. Barcelona: Labor.
- Pindyck, R. S.; Rubinfeld, D. L.** (1998): *Econometric models and economic forecasts*. Boston: McGraw-Hill.
- Raymond, J. L.; Uriel, E.** (1987): *Investigación econométrica aplicada: un caso de estudio*. Madrid: AC.
- Sargan, D.** (1988): *Lectures of advanced econometric theory*. Oxford: Backwell.

- Sims, C. A.** (1972): "Money, income and causality", *American Economic Review*, 62, pp. 540-552.
- Sims, C. A.** (1980): "Macroeconomics and Reality", *Econometrica*, Vol. 48, pp. 1-48.
- Sims, C. A.** (1982): "Policy Analysis with Econometric Models", *Brookings Papers on Economic Activity*, 1, pp. 107-164.
- Spanos, A.** (1992): "Towards a Unifying Methodological Framework for Econometric Modelling", en Granger [ed.]: *Modelling Economic Series*. Oxford University Press.
- Spanos, A.** (1993): *Statistical foundations of econometric modelling*. Cambridge University Press.
- Stock, J. H.; Watson, M. W.** (1978): "Variable Trends in Econometric Time Series", *Journal of Economic Perspectives*, 2, pp. 147-174.
- Suriñach, J.; Artís, M.; López, E.; Sansó, A.** (1995): *Análisis económico regional. Nociones básicas de la teoría de la cointegración*. Barcelona: Antoni Bosch y Fundació Bosch i Gimpera.
- Vandaele, W.** (1983): *Applied time series and Box-Jenkins models*. New York: Academic Press.
- Wei, W. W.** (1990): *Time series analysis*. Addison-Wesley.