

**FITXA IDENTIFICATIVA****Dades de l'Assignatura**

<b>Codi</b>	44947
<b>Nom</b>	Macroeconometria
<b>Cicle</b>	Màster
<b>Crèdits ECTS</b>	5.0
<b>Curs acadèmic</b>	2021 - 2022

**Titulació/titulacions**

<b>Titulació</b>	<b>Centre</b>	<b>Curs</b>	<b>Període</b>
2242 - Màster Universitari en Economia	Facultat d'Economia	1	Primer quadrimestre

**Matèries**

<b>Titulació</b>	<b>Matèria</b>	<b>Caràcter</b>
2242 - Màster Universitari en Economia	4 - Macroeconometria	Optativa

**Coordinació**

<b>Nom</b>	<b>Departament</b>
BRETO MARTINEZ, CARLES	10 - Anàlisi Econòmica
ROCHINA BARRACHINA, MARIA ENGRACIA	132 - Estructura Econòmica

**RESUM****CONEIXEMENTS PREVIS****Relació amb altres assignatures de la mateixa titulació**

No heu especificat les restriccions de matrícula amb altres assignatures del pla d'estudis.

**Altres tipus de requisits**



## COMPETÈNCIES (RD 1393/2007) // RESULTATS DE L'APRENTATGE (RD 822/2021)

### 2242 - Màster Universitari en Economia

- Que els estudiants sàpiguen aplicar els coneixements adquirits i la seua capacitat de resolució de problemes en entorns nous o poc coneguts dins de contextos més amplis (o multidisciplinaris) relacionats amb la seua àrea d'estudi.
- Que els estudiants posseïsquen les habilitats d'aprenentatge que els permeten continuar estudiant d'una forma que haurà de ser en gran manera autodirigida o autònoma.
- Posseir i comprendre coneixements que aportin una base o oportunitat de ser originals en el desenvolupament i / o aplicació d'idees, sovint en un context de recerca.
- Desenvolupar la capacitat crítica, impulsar la inquietud y el interés investigador en el ámbito de la economía, especializarse en el manejo de material bibliográfico, en la utilización de bases de datos económicas y programas matemáticos y estadísticoeconómicos, así como aprender a transmitir de forma adecuada los resultados de investigadora a través de artículos científicos y ponencias en congresos.
- Obtindre capacitats lingüístiques i tecnològiques: capacitat per a utilitzar l'anglès en l'àmbit científic de l'economia i per a utilitzar les TIC en l'àmbit de l'estudi i la investigació de l'economia.
- Saber utilitzar adequadament les tècniques econòmiques aplicades a l'anàlisi del funcionament de l'economia.
- Conèixer les bases de dades i bibliogràfiques necessàries per a la realització de treballs d'investigació econòmica.
- Saber manejar bases de dades i el seu processament utilitzant les tècniques i els paquets informàtics més adequats i actuals.

## RESULTATS D'APRENTATGE (RD 1393/2007) // SENSE CONTINGUT (RD 822/2021)

## DESCRIPCIÓ DE CONTINGUTS

1.

**VOLUM DE TREBALL**

ACTIVITAT	Hores	% Presencial
Classes de teoria	40,00	100
Pràctiques en aula	10,00	100
Estudi i treball autònom	75,00	0
<b>TOTAL</b>	<b>125,00</b>	

**METODOLOGIA DOCENT****AVALUACIÓ****REFERÈNCIES****Bàsiques**

- B. Pfaff (2011): Analysis of Integrated and Cointegrated Time Series with R, second edition. Springer.
- Harris, R.I.D. (1995): Using Cointegration Analysis in Economic Modelling, Prentice Hall.
- Juselius, K. (2007). The cointegrated VAR model: methodology and applications, Advanced texts in econometrics. Oxford University Press
- Econometric software: RStudio (<http://www.rstudio.com>); Gretl (<http://www.LearnEconometrics.com/gretl.html>)

**Complementàries**

- Dickey, D. A. and Fuller, W. A. [1979], Distributions of the estimators for autoregressive time series with a unit root, Journal of the American Statistical Association 74, 42743.
- Dickey, D. A. and Fuller, W. A. [1981], Likelihood ratio statistics for autoregressive time series with a unit root, Econometrica 49, 10571072.
- Engle, R. F. and Granger, C. W. J. [1987], Co-integration and error correction: Representation, estimation, and testing, Econometrica 55(2), 251276.
- Granger, C. W. J. [1981], Some properties of time series data and their use in econometric model specification, Journal of Econometrics 16, 150161.
- Hamilton, J. D. [1994], Time Series Analysis, Princeton University Press, Princeton, NJ.
- Hendry, D. F. [1986], Econometric modelling with cointegrated variables: An overview, Oxford Bulletin of Economics and Statistics 48(3), 201212.
- Johansen, S. [1991], Estimation and hypothesis testing of cointegration vectors in Gaussian vector autoregressive models, Econometrica 59(6), 15511580.
- MacKinnon, J. [1991], Critical values for cointegration tests, in R. F. Engle and C. W. J. Granger, eds, Long-Run Economic Relationships: Readings in Cointegration, Advanced Texts in Econometrics, Oxford University Press, Oxford, UK, chapter 13.



- Perron, P. [1988], Trends and random walks in macroeconomic time series, Journal of Economic Dynamics and Control 12, 297332.

## ADDENDA COVID-19

Aquesta addenda només s'activarà si la situació sanitària ho requereix i previ acord del Consell de Govern