

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

Codi	44947
Nom	Macroeconometria
Cicle	Màster
Crèdits ECTS	5.0
Curs acadèmic	2022 - 2023

Titulació/titulacions

Titulació	Centre	Curs	Període
2242 - M.U. en Economia 20-V.1	Facultat d'Economia	1	Primer quadrimestre

Matèries

Titulació	Matèria	Caràcter
2242 - M.U. en Economia 20-V.1	4 - Macroeconometria	Optativa

Coordinació

Nom	Departament
CABALLERO SANZ, FRANCISCO	10 - Anàlisi Econòmica
ROCHINA BARRACHINA, MARIA ENGRACIA	132 - Estructura Econòmica

RESUM

Per favor, consulteu la versió en anglés de la guia docent.

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



Per favor, consulteu la versió en anglés de la guia docent.

COMPETÈNCIES

2242 - M.U. en Economia 20-V.1

- 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 i l'interés investigador en l'àmbit de l'economia, especialitzar-se en el maneig de material bibliogràfic, en la utilització de bases de dades econòmiques i programes matemàtics i estadísticoeconòmics, així com aprendre a transmetre de forma adequada els resultats d'investigadora a través d'articles científics i ponències en congressos.
- 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 DE L'APRENTATGE

Per favor, consulteu la versió en anglés de la guia docent.

DESCRIPCIÓ DE CONTINGUTS

1. Per favor, consulteu la versió en anglés de la guia docent.

**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
TOTAL	125,00	

METODOLOGIA DOCENT

Per favor, consulteu la versió en anglés de la guia docent.

AVALUACIÓ

Per favor, consulteu la versió en anglés de la guia docent.

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.

