

Econometria I, 4 Curs Empresa, 1992-1993

Professors: Michael Creel (Primer Semestre), Montse Farell (Segon Semestre)

I. Descripció del Curs

Aquest curs és una introducció a l'econometria. El objecte del curs és donar una visió del que és l'econometria, per què pot servir, i un coneixement d'algunes dels seus mètodes més bàsiques. Per això, serà important entendre les idees generals i ser capaç d'analitzar problemes tal com tenir un cert facilitat amb coses més concretes.

II. Organització

Hi haurà un examen parcial per a cada semestre. Amb una nota més alta que 5 per tots dos parcials, ó un promig més alt que 5.5, no caldrà prendre l'examen final. L'examen final serà global. També hi haurà 6 conjunts de problemes (3 cada semestre) dels quals 5 seran obligatoris. Això s'aplica a la gent que no poden assistir a classe també. Els exercicis seran avaluats com "satisfactori" ó "no satisfactori". La gent que no fan els exercicis ó reben un "no satisfactori" rebran un penal de 0.20 punts de les 10 punts possibles de la nota final per a cada instància.

III. Hores d'oficina, Primer Semestre

Faré hores d'oficina cada Dimecres entre les 4 i les 7. El meu despatx és numero B3-162 al Dept. D'Economia i d'Hist. Econ. El meu numero de telèfon és 581-2194. Si no pots venir a les hores normals, es pot fer una cita per una hora més convenient.

IV. Programa per l'any

1. Introducció i repàs de conceptes fonamentals.
2. L'estimador mínim quadrat ordinari.
3. Mínims quadrats amb restriccions.
4. Multicolinealitat
5. Autocorrelació
6. Heteroscedasticitat
7. Variables fictícies, estacionalitat i canvi estructural
8. Errors d'especificació
9. Mínims quadrats generalitzats i l'estimador SURE
10. Models dinàmics
- 11*. Introducció a models simultanis
- 12*. Introducció a l'anàlisi de sèries temporals. *Si permet el temps.

V. Bibliografia

Es pot trobar el següents llibres a la llibreria:

J. Johnston, Métodos de econometría, 2 ed., Vincens Vives. Aquest llibre és una mica avançat.

D. Gujarati, Econometría basica (ó títol similar). Una presentació més senzill i intuïtiu.

A. Novales, Econometría, McGraw-Hill. No he vist aquest llibre. També hi ha molts llibres en la biblioteca.