

Econometría I

4 Curs Empresa, grups 02(matí), 50(tarda), 1993-1994.

Professors: Montserrat Farell (1^{er} semestre) i Michael Creel (2ⁿ semestre).

Descripció i Objectius del Curs : Aquest curs es una introducció a la econometría. Els objectius són: entendre els conceptes teòrics bàsics, saber aplicar alguns del mètodes més utilitzats i interpretar resultats.

Organització: Hi ha dues maneres de passar el curs en la convocatòria de Juny.

I) Passar per curs:

i) Hi haurà dos examens parcials. Cada examen serà evaluat de 0 a 10 punts.

Per a passar el curs s'ha d'obtenir una mitja de 5 en l'evaluació dels dos examens i s'ha de passar cada examen amb un 4 o més.

Això vol dir que la persona que no tingui un mínim de 4 en el primer examen ha d'anar a examen final. La persona que passi el primer parcial però tregui menys d'un 4 en el segon parcial també haurà d'anar a final.

ii) S'haurà d'entregar tres exercicis obligatoris, que contaràn un 10% de la nota final. Aquests exercicis es faràn durant el segon semestre. Tots els exercicis s'hauran de resoldre amb ordinador (per això tenim la nova aula informàtica amb 30 ordinadors a la vostra disposició), per el que us caldrà aprendre les comandes més bàsiques del sistema operatiu DOS i el mínim indispensable d'un llenguatge de programació i comandes (especial per estadística i econometría GAUSS) que us permetera realitzar els exercicis.

$$\text{nota final} = [\text{exercicis} \times 0.1] + [\text{parcial 1} \times 0.45] + [\text{parcial 2} \times 0.45]$$

II) Examen Final: No hi ha parts diferenciades per primer o segon parcial. Es un examen global del que s'ha fet durant tot l'any. Serà evaluat de 0 a 10 i s'aprovara l'assignatura amb un 5 o més.

III) Tutoríes, primer semestre:

Despatx B3-172, l'horari serà els dilluns de 10:30-12:30 i dimarts de 18-19.

IV) Programa:

1. Introducció i repàs dels conceptes fundamentals.
2. L'estimador Minim Quadrat Ordinari.
3. Multicolinealitat.
4. Minims Quadrats amb restriccions.
5. Variables fictícies i canvi estructural.
6. Errors d'especificació.
7. Minims Quadrats Generalitzats i l'estimador SUR..
8. Models Dinàmics.
9. Introducció a Models Simultanis.
10. Selecció de Models.

Bibliografia: D. GUJARATI. Econometría
edit: McGraw-Hill

J. Johnston. Métodos de Econometría
edit: Vicens-Vives