

Econometria II

Professora: Montserrat Farell

Despatx: B3-172. Telf. 5811717.

Tutories: Dilluns 10:30-12:30

Dimarts 18-19

Organitzacio:

- i) Hi haurá dos examens parcials. El primer valdrá un 30% de la nota final. El segón un 40 %.
- ii) S'haurá de fer 6 exercicis que valdrán el 30% restant que forma la nota final.
- iii) Hi haurá també un examen final per a qui no passi per curs o per a qui volgui pujar nota.

Objectius:

- i) Asolir una certa familiaritat amb els conceptes teòrics més importants de cada tema. Cosa que s'aconseguirà estudiant més a fons la teoria ja vista en el curs d'econometria de quart i també estudiant nous temes.
- ii) Analitzar casos empírics. Aixó implicará analitzar un problema, suposat o real, proposar un model econométric adequat, utilitzar un mètode d'estimació consistent i realitzar el treball en el ordinador. Per aixó, podreu utilitzar la nova aula informàtica. Us caldrá aprendre les comandes bàsiques del sistema operatiu DOS. També el llenguatge i comandes mínim (necessari per a realitzar els exercicis), d'un llenguatge especial per estadística i econometria anomenat GAUSS.

Programa:

1. L'estimador MQO.
2. L'estimador MQG.
3. Formes Funcionals i Selecció de Models.
4. Models amb Restriccions (fixes i estocàstiques).
5. Models amb Variables Fictícies, Discretes i Truncades.
6. Models d'Equacions Simultànies.
7. Models Dinàmics i D'Expectatives.
8. Variables amb Errors.
9. Introducció a les Series Temporals.
10. Vectors Autorregressius, Arrels Unitaries i Cointegració.

Bibliografia:

Maddala, G. S.: Introduction to Econometrics, edit. MacMillan (1992).

Maddala, G.S.: Econometria, edit. MacMillan (1985)

KMenta, I. Elements of Econometrics.

Johnston, J. : Métodos de Econometria, edit. Vicens-Vives.

Durant el curs aniré recomenat els articles més rellevants sobre el tema que estiguem tractant.