

Models Economètrics de Previsió i Anàlisi Quantitatius

Professora: Montserrat Farell

Despatx: B3-172. Telf. 5812932.

Objectius:

- i) Assolir 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 anterior i també estudiant nous temes.
- ii) Analitzar casos empírics. Això implicarà analitzar problemes, suposats (generant dades) o reals (amb dades reals), proposar un model economètric adequat, utilitzar un mètode d'estimació consistent i realitzar el treball en el ordinador. Per això, podreu utilitzar la nova aula informàtica. Us caldrà aprendre les comandes bàsiques del sistema operatiu DOS. També el llenguatge i comandes mínim, necessari per a fer els exercicis, d'un llenguatge de programació especial per a estadística i econometria anomenat GAUSS.

Programa:

- 1. Revisió de l'estimador MQO.
- 2. L'estimador MQG.
 - i) Models amb dades de Panel
 - ii) Estimació SUR.
- 3. Models amb Restriccions (fixes i estocàstiques).
- 4. Errors d'Especificació, Formes Funcionals i Selecció de Models.
- 5. Introducció a l'anàlisi de Sèries Temporals.

Bibliografia:

Kmenta, J. Elements of Econometrics, MacMillan.
Johnston, Metodos de econometria, Vicens-Vives.
Greene, W.H. Econometric Analysis.
Hamilton, J. Time Series Analysis, Princeton.