

Econometria I	25045	Grup 3
----------------------	-------	--------

Curs acadèmic	Cicle	Semestre
2001/02	segon	primer i segon

Professora	Despatx	Telèfon Despatx
Maite Cabeza Gutés	B3-164	93 581 2195

PROGRAMA

DESCRIPTOR OFICIAL DE L'ASSIGNATURA

El model de regressió general, estimació, inferència i predicció. Estimació amb restriccions, variables fictícies i multicolinearitat.

PREREQUISITS

És molt important que l'estudiant tingui els cursos de matemàtiques i estadística superats.

METODOLOGIA

El curs es composarà de classes teòriques i classes pràctiques. Algunes classes pràctiques es realitzaran a l'aula d'informàtica. Es posarà especial èmfasi en veure exemples d'aplicacions de les eines presentades.

En les classes teòriques s'utilitzaran sovint transparències, una còpia de les quals es trobarà amb antelació suficient a la carpeta de l'assignatura del Campus Virtual. Es convenient portar una còpia en paper d'aquestes transparències a classe. (Per accedir a la carpeta de l'assignatura del Campus Virtual necessiteu utilitzar el nom d'usuari i el password que teniu per Cesar. Si no esteu donats d'alta, feu-ho a la Secretaria de la Facultat. És gratuït.)

BIBLIOGRAFIA

Els apunts de classe són importants però no són el manual de l'assignatura. És molt important que cada estudiant ampliï el material presentat a classe amb les lectures dels nombrosos textos d'econometria disponibles. Entre d'altres recomano:

- Gujarati,D.N. (1997), *Econometria*. Tercera edició. McGraw-Hill.
- Maddala, G.S.(1996), *Introducción a la econometria*, Segona edició. Prentice Hall
- Johnston,J.& Dinardo,J.(2001), *Métodos de Econometría*. Vicens Vives.
- Pindyck,R.S. & Rubinfeld, D.L. (2001), *Econometria: modelos y pronósticos*, McGraw-Hill.

Quarta Edició.

TEMARI

Primer Semestre:

1. Introducció
2. El model de regressió amb dues variables: Estimació
3. El model de regressió amb dues variables: Inferència i Predicció
4. El model de regressió amb k-variables
5. Extensions al model de regressió
 - 5.1. Estimació amb restriccions
 - 5.2. Variables fictícies
 - 5.3. Multicolinearitat

Segon Semestre:

1. Introducció al model de regressió generalitzat
2. Heteroscedasticitat
3. Autocorrelació
4. Models de regressió amb variables retardades
5. Introducció als models amb sèries temporals
6. Models de sèries temporals

SISTEMA D'AVALUACIÓ

Tot estudiant té dues opcions per passar l'assignatura:

opció 1: mitjançant la realització de 4 parcials (90%) i de 4 exercicis pràctics (10%). (La nota mínima de cada parcial ha de ser superior a 3.5 per poder optar a aquesta opció.)
Dates dels parcials: 1) **27 de novembre** 2) **30 de gener** 3) **16 abril** i 4) **6 de juny**.

opció 2: directament al final (Juny-Juliol)

CONSIDERACIONS GENERALS IMPORTANTS

- *En cap cas es pot canviar la data d'examen marcada, ni es guardarà la nota feta en una convocatòria no vigent de l'estudiant. Tampoc es guarden parcials entre convocatòries.*
- *Només podran realitzar l'examen les persones matriculades en el grup 03.*
- *En cap cas, alhora d'avaluar, es tindran en compte criteris com: treballar a fora, ser l'última assignatura per acabar la carrera, etc....*

Horari de Tutories (despatx: B3-164):

dimarts : 11.30 - 12.00

dimecres: 3 - 4.30