

Assignatura

Codi

Econometria	25045
--------------------	--------------

Curs acadèmic	Cicle	Quadrimestre
2001/2002	2	Febrer-Juny

Grup/s	Professors	Despatx	Telèfon Despatx
51	Conxita Pinyol	B3-192	93 581 1805
52	Conxita Pinyol	"	

PROGRAMA

DESCRIPTOR OFICIAL DE L'ASSIGNATURA

Models de regressió, problemes especials (multicolinealitat, autocorrelació i heterocedasticitat). Errors d'especificació. Mínims quadrats generalitzats, variables instrumentals, models dinàmics i introducció a l'anàlisi de sèries temporals i als models d'equacions simultànies.

OBJECTIUS DE L'ASSIGNATURA

Aquest es un curs introductori als fonaments de l'econometria. Aquest quadrimestre es cobreixen els temes referits als problemes especials (multicolinealitat, autocorrelació i heterocedasticitat), així com al anàlisi de sèries temporals.

PREREQUISITS

Estadística I i II

METODOLOGIA

Es tracte d'un curs analític i pràctic. La resolució de la llista de problemes de l'assignatura constitueix una condició necessària per a superar el curs. Es faran classes pràctiques a la sala d'ordinadors i es resoldran problemes amb el programa EconometricView

TEMARI DETALLAT DELS CONTINGUTS

1. El model de Regressió Generalitzat.

- 1.1 L'estimador de mínims quadrats generalitzats.
- 1.2 El problema de l'heteroscedasticitat: Detecció i contrast, estimació.
- 1.3 El problema de l'autocorrelació: Detecció i contrast, estimació.

2. Models dinàmics.

- 2.1 Introducció.
- 2.2 Models de retards infinits: El model de Koyck.
- 2.3 Models de retards finits: El model d'Almon.
- 2.4 Estimació.

3. Introducció a l'Anàlisi de Sèries Temporals.

3.1 Models de sèries temporals univariants

3.2 Processos no estacionaris, arrels unitàries i cointegració.

BIBLIOGRAFIA

Johnston, J. (1987): Métodos de econometría. 3ª edición. Vicens Vives.

Gujarati, D.N. (1997): Econometría. 3ª edición. McGraw-Hill.

Maddala, G.S. (1996): Introducción a la Econometría. 2ª edición. Ed. Prentice Hall.

Fernandez et al. (1995): Ejercicios de econometría. Schaum. Ed McGraw-Hill

Kmenta, J. (1980): Elementos de econometría. 2ª ed. Ed. Vicens Vives

Pindyck R. y Rubinfeld D. (1980): Modelos econométricos. Ed. Labor.

NORMES D'EXAMEN I AVALUACIONS

L'avaluació del segon semestre es basarà:

Opció 1: El promig entre les notes de dos exàmens: Un examen es realitzarà el 8 d'Abril i l'altre el 3 de juny.

Opció 2: Nota de l'examen final que es realitzarà en la data fixada per la Comissió de Docència.

NO ES GUARDARAN NOTES PARCIAIS SOTA CAP CIRCUMSTANCIA

HORES TUTORIES

PROFESSOR	HORARI TUTORIES
Conxita Pinyol	Dimarts de 17:45h. a 19:15h.
	Dijous de 15h. a 16:30h.