

Models Economètrics	25087
----------------------------	-------

Curs acadèmic	Cicle	Quadrimestre
2007/2008	2	setembre-febrer

Grup/s	Professors	Despatx	Telèfon Despatx
1	Conxita Pinyol	B3-192	93 581 1805

PROGRAMA

METODOLOGIA

Es tracte d'un curs que combina l'estudi analític amb l'estudi numèric. Al llarg del curs es faran problemes i pràctiques amb ordinador amb el programa GRETL.

TEMARI DETALLAT DELS CONTINGUTS

- 1. El model de regressió. Principals resultats**
- 2. Interpretant i Comparant Models de Regressió**
 - 2.1. Interpretant el Model lineal
 - 2.2. Errors d'especificació
 - 2.3. Selecció de models
 - 2.4. Aplicacions
- 3. Endogeneïtat i variables instrumentals**
 - 3.1. Revisió de les propietats de l'estimador de MQO.
 - 3.2. L'estimador de Variables Instrumentals.
 - 3.3. Test d'exogeneïtat de Hausman.
 - 3.4. Aplicacions.
- 4. Models de sèries de temporals Univariants**
 - 4.1. Estacionarietat. La funció d'autocorrelació.
 - 4.2. Processos ARMA.
 - 4.3. Estacionarietat i arrels unitàries.
 - 4.4. Test d'arrels unitàries.
 - 4.5. Identificació de Models ARMA.
 - 4.6. Estimació de models ARMA.
 - 4.7. Predicció.
 - 4.8. Aplicacions.
- 5. Models de sèries Temporals Multivariants**
 - 5.1. Models Dinàmics amb variables estacionaries.
 - 5.2. Models amb variables no estacionaries.
 - 5.2.1. Regressió espúria.
 - 5.2.2. Cointegració.
 - 5.2.3. Cointegració i Mecanismes de correcció d'error.
 - 5.2.4. Aplicacions.

BIBLIOGRAFIA

- Greene, W.H. (1997), "Econometric analysis", Prentice-Hall
- Johnston, J y Dinardo, J (1997), "Econometric methods", McGraw-Hill
- Verbeck, M. (2000), "A guide to modern econometrics", John Wiley and Sons

NORMES D'EXAMEN I AVALUACIONS

Un examen que puntuarà el 60% de la nota
2 treballs que puntuaran el 40% de la nota

HORES TUTORIES

PROFESSOR	HORARI TUTORIES
Conxita Pinyol	Dijous de 9:00h. a 10:30h.
	Divendres de 10:30h. a 12h.