

Universitat Autònoma de Barcelona

Grupos: ECO 51 y ADE 52

Teoría: Lúdia Farré

Prácticas: Diego Caramuta (ECO51); Pau Pujolas (ADE 52)

ECONOMETRÍA I. Curso 2009/2010

Llicenciatura en Economía y en Administración y Dirección de Empresas

PROGRAMA DE “ECONOMETRÍA I”

1. Introducción

- 1.1. Objetivos y metodología de la Econometría.
- 1.2. Ejemplos de usos y aplicaciones.

2. Modelo Lineal General (MLG): Estimación MCO

- 2.1. Formulación del MLG: especificación del modelo e hipótesis básicas.
- 2.2. Estimación MCO: Definición y propiedades estadísticas
 - 2.2.1. Estimación MCO en el modelo de regresión simple
 - 2.2.2. Estimación MCO en el modelo de regresión múltiple
 - 2.2.3. Interpretación de los parámetros estimados, unidades de medida y forma funcional.
 - 2.2.4. Propiedades estadísticas del estimador MCO de β .
 - 2.2.5. Estimación de σ^2 y propiedades estadísticas del estimador
 - 2.2.6. Matriz de varianzas estimadas y errores estándar
- 2.3. Propiedades del ajuste MCO.

3. Modelo Lineal General (MLG) con errores normales.

- 3.1. Distribución de formas cuadráticas asociadas a la distribución normal.
- 3.2. Propiedades de los estimadores MCO con errores normales.

4. Contrastes de hipótesis en el MLG

- 4.1. Contrastes de restricciones lineales.
 - 4.1.1. Contrastes sobre un único coeficiente
 - 4.1.2. Contrastes de una restricción lineal
 - 4.1.3. Contrastes de un conjunto de restricciones lineales
- 4.2. Estimación con restricciones lineales.
- 4.3. Intervalos de confianza

5. Variables binarias

- 5.1. Variables binarias

BIBLIOGRAFIA

Bibliografía básica:

- Greene, W. H. *Análisis econométrico*. Prentice Hall. 1998.
- Gujarati, D. (2003), *Econometria*, McGraw-Hill. Cuarta edición.
- Johnston, J. i J. Dinardo, *Métodos de Econometria*, Vicens Vives
- Maddala, G.S.(1996), *Introducción a la econometria*, Segunda edición, Prentice Hall
- Pindyck, R.S. & Rubinfeld, D.L. (2001), *Econometria: modelos y pronósticos*, McGraw-Hill.
- Wooldridge, J. M. (2003), *Introducción a la Econometria*, Thompson. 2a ed.

MATERIALES

A lo largo del curso se irá entregando a los alumnos el material siguiente:

- transparencias de cada tema
- una hoja de problemas por tema, y soluciones de algunos ejercicios significativos.
- Enunciados de los problemas prácticos a realizar en el ordenador.
- Ficheros de datos para la resolución de los problemas del apartado anterior

El material estará disponible para los alumnos en Campus Virtual con suficiente antelación antes de su uso en clase

PRÁCTICAS

Cada tema va acompañado de una hoja de problemas. Adicionalmente, habrá dos prácticas de ordenador en las que se enseñará a los alumnos el manejo del programa informático Gretl. Este programa puede descargarse de la página web <http://gretl.sourceforge.net>. Se avisará a los alumnos con suficiente antelación sobre la fecha y lugar en que se desarrollarán estas prácticas de ordenador. Tanto las hojas de problemas como las prácticas de ordenador serán materia de examen.

EVALUACIÓN

Examen tradicional. En el examen habrá una pregunta de carácter teórico y varios problemas y cuestiones, del mismo tipo de los contenidos en las hojas de problemas o sobre las prácticas de ordenador.

Assignatura	Codi
Econometria	25045

Curs acadèmic	Cicle	
2009-2010	2	anual

Semestre	Grup	Professor
primer	1	Maite Cabeza
	2	
	4	Daniela Iorio
	51	Lidia Farré
	52	Lidia Farré
	60	Josep LLuis Raymond
segon	1	Maite Cabeza
	2	Conxita Pinyol
	4	Maite Cabeza
	51	Conxita Pinyol
	52	Anna Sanz
	60	Josep LLuis Raymond

PROGRAMA

INTRODUCCIÓ
 EL MODEL DE REGRESSIÓ LINEAL CLÀSSIC
 ESTIMACIÓ I INFERÈNCIA
 ESTIMACIÓ SOTA RESTRICCIONS
 VARIABLES FICTÍCIES
 COLINEALITAT
 ERRORS D'ESPECIFICACIÓ
 HETEROSQUEDASTICITAT
 AUTOCORRELACIÓ
 MODELS DINÀMICS

REFERÈNCIES

Gujarati, D. (2003), *Econometria*, McGraw-Hill. Quarta edició.
 Johnston, J. i J. Dinardo, *Métodos de Econometria*, Vicens Vives
 Maddala, G.S.(1996), *Introducción a la econometria*, Segunda edición, Prentice Hall
 Pindyck, R.S. & Rubinfeld, D.L. (2001), *Econometria: modelos y pronósticos*, McGraw-Hill.
 Wooldridge, J. M. (2003), *Introducción a la Econometria*, Thompson. 2a ed.

NORMES D'EXAMEN I AVALUACIONS

Hi haurà un examen corresponent a la matèria del primer semestre, el dia 13/01/2010 a les 17:30 (data oficial per aquest parcial). L'examen corresponent a la matèria del segon semestre, serà el dia 17/06/2010 a les 9 (data oficial de la primera convocatòria). Aquest mateix dia, els estudiants tindran opció de repetir l'examen de la matèria del primer semestre.

Per aprovar l'assignatura es necessita que la mitjana entre les notes obtingudes per cada semestre sigui igual o superior a 5, sempre hi quan la nota corresponent a cada parcial sigui d'un mínim de 4.

Aquells estudiants que no compleixin aquest requisit, han d'anar a la segona convocatòria, el dia 2/9/2010, a les 17:30. De cara a setembre, l'estudiant té l'opció de que se li guardi la nota de la matèria d'un semestre obtinguda al febrer o al juny, sempre hi quan aquesta sigui d'un mínim de 4. (És a dir, un estudiant que ha obtingut un 4,5 del primer semestre i un 5,5 en el segon, aprova l'assignatura, però si ha obtingut un 8 i un 2, llavors s'ha de tornar a examinar obligatòriament de la matèria del segon semestre al setembre).

Informació específica del primer semestre: Grups 1 i 2**Professors:**

Responsable: Maite Cabeza (despatx: B3-134 tutories: divendres, 9:00-11:00)

Ajudants: Grup 1: Darina Grechyna (despatx: B3-118 tutories: dijous, 12:00-13:30)

Grup 2: Diego Caramuta (despatx: B3-118 tutories: divendres: 10-11:30)

Les classes de teoria seran els dimarts i dijous. Les classes pràctiques seran el divendres.

Temari

1. Introducció
2. El model de regressió simple: Estimació
3. El model de regressió simple: Inferència i Predicció
4. El model de regressió multiple

Software

S'utilitzarà el paquet economètric de lliure accés (*open source*) **Gretl**.

Web de l'assignatura:

<http://pareto.uab.cat/mcabeza>

La pàgina web és la principal forma de comunicació amb els estudiants. Hi trobareu, segons es necessiti el següent material:

- Informació sobre la instal·lació de Gretl
- Per cada tema:
 - còpia de les transparències utilitzades a classe (*.f)
 - exercicis (*.ex)
 - fitxers de dades (*.xls)
- Exercici a entregar el 13/1/2010 (dia de l'examen parcial)
- Models d'examens d'altres anys

El primer dia de classe es proporcionarà el codi que necessiteu per poder accedir als fitxers penjats a la web.

Avaluació del primer semestre:

La nota corresponent al primer semestre = $\max \{90\% \text{examen} + 10\% \text{treball}, 100\% \text{examen}\}$. El primer examen corresponent a la matèria del primer semestre serà el dia **13/1/2010**. Qui ho necessiti, podrà tornar a examinar-se d'aquesta matèria a la data oficial de la primera convocatòria (**17/6/2010**) o de la segona convocatòria (**2/9/2010**).

Consideracions generals importants:

En cap cas es pot canviar la data d'examen marcada, ni guardar la nota feta en una convocatòria no vigent de l'estudiant.

En cap cas, alhora d'avaluar, es tindran en compte criteris com: treballar a fora, ser l'última assignatura per acabar la carrera, etc, etc,.....

Recordeu que no es respondran correos electrònics que demanin informació que ja està a la web. Tampoc es poden atendre tutories via correu electrònic.