



Universitat de Girona
Facultat de Ciències Econòmiques i Empresariales

Llicenciatura Economia
Curs 2001-2002

assignatura troncal
9 crèdits

Departament d'ECONOMIA
Campus de Montilivi
17071 Girona
fax +34 972 41 80 32
marc.saez@udg.es

PROGRAMA d'ECONOMETRIA

Professors: Marc Sáez

Objectius:

L'ensenyament de l'Econometria ha de permetre assolir els coneixements metodològics suficients per a la comprensió de la investigació aplicada i la realització de treballs amb base empírica. Així, es pretenen combinar els fonaments teòrics amb la metodologia economètrica per tal de fer possible l'aplicació dels models economètrics en l'anàlisi estructural, la contrastació de les hipòtesis teòriques i la predicció i la simulació de conductes.

Programa teòric:

PART I. Econometria Clàssica i Macroeconometria.

1.- Introducció a l'anàlisi de sèries temporals.

1.1.- Conceptes preliminars: processos estocàstics, condicions d'estacionarietat i funcions d'autocorrelació simple (FAS) i parcial (FAP).

1.2.- Processos estocàstics estacionaris.

1.2.1.- Processos autorregressius (AR).

1.2.2.- Processos de mitjanes mòbils (MA).

1.2.3.- Processos mixtos (ARMA).

1.3.- Processos integrats (ARIMA) i estacionals (SARIMA).

1.4.- La metodologia Box-Jenkins.

1.5.- Predicció puntual i per interval.

1.6.- Avaluació de la capacitat predictiva.

1.5.- *Cas 1. Anàlisi d'algunes sèries temporals per la metodologia Box-Jenkins (P).*

2.- Variables exògenes qualitatives.

2.1.- Especificació de models amb variables exògenes qualitatives.

2.2.- Variables fictícies i efectes estacionals.

2.3.- Variables fictícies i canvi estructural.

2.4.- *Cas 2. Factors explicatius de costos directes hospitalaris (P).*

3.- Pertorbacions no esfèriques. Heterocedasticitat.

3.1.- Definició de les pertorbacions no esfèriques, causes i conseqüències de l'estimació per MQO.

3.2.- Contrasts d'heterocedasticitat.

3.3.- Mètodes d'estimació alternatius. Mínim Quadrats Generalitzats (MQG) i Mínim Quadrats Ponderats (MQP).

3.4.- *Cas 2. Factors explicatius de costos directes hospitalaris (P).*

4.- Regressors estocàstics. Models dinàmics.

4.1.- Models dinàmics.

4.1.1.- Models amb retards en les variables exògenes.

4.1.2.- Models amb variable endògena retardada.

4.2.- Contrastos d'exogeneïtat i d'autocorrelació.

4.3.- Estimació de paràmetres i contrastos: MQO, MV i Variables instrumentals.

4.4.- *Cas 3. Estimació d'una equació de demanda del turisme internacional per a Espanya (P).*

5.- Models dinàmics de sèries temporals.

5.1.- Processos estocàstics no estacionaris i arrels unitàries. Contrastos d'arrels unitàries.

5.2.- Anàlisi de Cointegració. Tendències comunes i contrastos.

5.3.- Mecanismes de correcció de l'error.

5.4.- Heterocedasticitat condicional autorregressiva generalitzada.

5.5.- *Cas 4. El model CAPM generalitzat (P).*

PART II. Microeconometria.

6.- Models amb variable dependent discreta. Models d'elecció binària.

6.1.- Variable dependent limitada: tipus i especificació.

6.2.- El model lineal de probabilitat.

6.3.- Especificació i estimació del model probit i de la regressió logística.

6.4.- Validació del model.

6.5.- *Cas 5. Anàlisi econòmica de la incidència de la incapacitat temporal (P).*

7.- Models amb variable dependent limitada.

7.1.- Dades censurades.

7.2.- Models Tobit.

7.3.- Efectes de tractament i mètodes en dues etapes.

7.4.- *Cas 5. Anàlisi econòmica de la incidència de la incapacitat temporal (P).*

8.- Models per a dades de panel.

8.1.- Especificació del model.

8.2.- Estimació pooled.

8.3.- Efectes fixes i efectes aleatoris.

8.4.- Models condicionals i marginals.

8.5.- Variable dependent no normal.

8.6.- *Cas 6. Anàlisi dels factors explicatius de la despesa dels turistes estrangers a Catalunya (P).*

9.- Anàlisi de duració.

9.1.- Estimació i comparació de corbes de supervivència. Estimador de Kaplan-Meier i contrast log-rank.

9.2.- Models de temps de vida accelerada.

9.3.- Model de riscos proporcionals. Model de Cox.

9.4.- Variables temps-depenents i múltiples recurrències. El model d'Andersen-Gill.

9.5.- Validació del model.

9.6.- *Cas 5. Anàlisi econòmica de la incidència de la incapacitat temporal (P)*

Programa de pràctiques:

PART I. Econometria Clàssica i Macroeconometria.

1.- Introducció a l'anàlisi de sèries temporals.

1.5.- *Cas 1. Anàlisi d'algunes sèries temporals per la metodologia Box-Jenkins (P).*

2.- Variables exògenes qualitatives.

2.4.- *Cas 2. Factors explicatius de costos directes hospitalaris (P).*

3.- Pertorbacions no esfèriques. Heterocedasticitat.

3.4.- *Cas 2. Factors explicatius de costos directes hospitalaris (P).*

4.- Regressors estocàstics. Models dinàmics.

4.4.- *Cas 3. Estimació d'una equació de demanda del turisme internacional per a Espanya (P).*

5.- Models dinàmics de sèries temporals.

5.5.- *Cas 4. El model CAPM generalitzat (P).*

PART II. Microeconometria.

6.- Models amb variable dependent discreta. Models d'elecció binària.

6.5.- *Cas 5. Anàlisi econòmica de la incidència de la incapacitat temporal (P).*

7.- Models amb variable dependent limitada.

7.4.- *Cas 5. Anàlisi econòmica de la incidència de la incapacitat temporal (P).*

8.- Models per a dades de panel.

8.6.- *Cas 6. Anàlisi dels factors explicatius de la despesa dels turistes estrangers a Catalunya (P).*

9.- Anàlisi de duració.

9.6.- *Cas 5. Anàlisi econòmica de la incidència de la incapacitat temporal (P).*

Les classes pràctiques (P) es realitzaran a les aules d'informàtica.

Desenvolupament del programa al llarg del curs:

PART I Primer quadrimestre 14 setmanes

Lliçó 1: 4 setmanes

Lliçó 2: 2 setmanes

Lliçó 3: 2 setmanes

Lliçó 4: 3 setmanes

Lliçó 5: 3 setmanes

PART II Segon quadrimestre 14 setmanes

Lliçó 6: 4 setmanes

Lliçó 7: 3 setmanes

Lliçó 8: 4 setmanes

Lliçó 9: 3 setmanes

Sistema d'avaluació:

Per tal de superar l'assignatura s'ha d'aprovar l'examen final de la convocatòria de juny. No obstant això, i a efectes alliberatoris de la part corresponent, els alumnes podran realitzar dues proves parcials, una a febrer i altra a juny, de caràcter independent. Es farà promig a partir de 4 (sobre 10). A més, en cada quadrimestre els alumnes hauran de realitzar un treball pràctic sobre la matèria impartida en el mateix. Aquests dos treballs representaran com a màxim del 20% de la nota final del curs, sempre i quan s'hagi superat l'assignatura.

Bibliografia bàsica:

Saez, M. i Barceló, M.A. (1998): *Econometría. Introducción y Casos Prácticos*. Madrid: Centro de Estudios Ramón Areces.

Greene, W.H. (1999): *Análisis Económico*. 3ª edición. Madrid: Prentice-Hall Iberia S.R.L.

Johnston, J. i Dinardo, J. (2001): *Métodos de Econometría*. Barcelona: Vicens-Vives.

Alegre, J.; Juaneda, N. i Riera, A. (1999): *Models d'Elecció Discreta i Models amb Dades de Panel*. Palma de Mallorca: Universitat de les Illes Balears.

Bibliografia complementària:

Berndt, E.R. (1991): *The Practice of Econometrics. Classic and Contemporary*. Reading, Massachussets: Addison-Wesley.

Guisán, M.C. (1997): *Econometría*. Madrid: McGraw-Hill.

Maddala, G. (1985): *Econometría*. Madrid: McGraw-Hill.

Martín, G.; Labeaga, J.M. i Mochón, F. (1997): *Introducción a la Econometría*. Madrid: Prentice-Hall.

Novalés, A. (1993): *Econometría*. Madrid: McGraw-Hill.