



UNIVERSITAT
ROVIRA I VIRGILI

FACULTAT DE CIÈNCIES
ECONÒMIQUES I EMPRESARIALS

Llicenciatura en Administració i Direcció
d'Empreses
Pla d'estudis de 1992

16012025
Econometria I
(4,5 crèdits)

Llicenciatura en Administració i Direcció d'Empreses
Pla estudis 1992
Codi Assignatura: 16012025
Nom Assignatura: Econometria I
Crèdits: 4.5

Objectius de l'assignatura i criteris d'avaluació

Examen al finalitzar el quadrimestre. Exercicis numèrics i desenvolupament de supòsits pràctics utilitzant el programa ECONOMETRIC VIEWS.

Segona convocatòria al mes de setembre.

Tema 1 . EL MODEL ESTÀNDARD DE REGRESSIÓ LINEAL SIMPLE.
ESTIMACIÓ MQO

1.1 Hipòtesis bàsiques

1.2 Estimació dels paràmetres per MQO

1.3 Propietats dels estimadors MQO

1.3.1 Teorema de Gauss-Markov

1.4 Estimació de la variància del terme de pertorbació

1.5 Bondat de l'ajust

1.5.1 Coeficient de determinació

1.6 Estimació per intervals dels paràmetres del model

1.7 Contrast d'hipòtesis sobre els paràmetres del model

1.8 Predicció puntual

1.8.1 Predicció per intervals

Tema 2 . MODEL ESTÀNDARD DE REGRESSIÓ LINEAL MÚLTIPLE. VERSIÓ
MATRICIAL. ESTIMACIÓ MQO

2.1 Hipòtesis bàsiques

2.2 Estimació dels paràmetres per MQO

2.3 Propietats dels estimadors MQO

2.3.1 Teorema de Gauss-Markov

2.4 Propietats dels residus

2.4.1 Estimació de la variància del terme de pertorbació

2.5 Mesures de la bondat de l'ajust

2.6 Estimació per intervals dels paràmetres del model

2.7 Contrast d' hipòtesis sobre els paràmetres del model

2.8 Predicció puntual

2.8.1 Predicció per interval

2.9 Contrast de significació per a un grup de variables

2.10 Contrast de significació global del model

Tema 3 . RESTRICCIONS SOBRE ELS PARÀMETRES DEL MODEL DE REGRESSIÓ MÚLTIPLE ESTÀNDAR

3.1 Definició

3.1.1 Exemples

3.2 Tipus de restriccions

3.3 Restriccions lineals i de valor fix

3.3.1 Estimació dels paràmetres del model (MQR)

3.4 Propietats dels estimadors obtinguts per MQR

3.5 Contrast d'hipòtesis sobre les restriccions lineals i de valor fix

Tema 4 . RELAXACIÓ DE LES HIPÒTESIS BÀSIQUES

4.1 Estabilitat estructural

4.2 L'hipòtesis de normalitat de les pertorbacions

4.3 Regressors estocàstics

4.4 Mínims Quadrats Generalitzats

Tema 5 . HETEROSCEDASTICITAT

5.1 Naturalesa i conseqüències

5.2 Detecció del problema

5.3 Solucions

Tema 6 . AUTOCORRELACIÓ

6.1 Naturalesa

6.1.1 Causes i conseqüències

6.2 Detecció del problema

6.3 Estimació amb pertorbacions que segueixen un esquema autorregressiu

Tema 7 . PROBLEMES AMB LA INFORMACIÓ MOSTRAL

7.1 Multicolinealitat

7.1.1 Definició

7.1.2 Graus i conseqüències en l'estimació MQO

7.2 Detecció i valoració de la seva importància

7.3 Solucions possibles

Tema 8 . ERRORS D'ESPECIFICACIÓ

8.1 Errors d'especificació dels regressors

8.2 Omissió de variables rellevants

8.3 Inclusió de variables supèrflues

8.4 Errors en l'especificació de la forma funcional

8.4.1 Contrast Reset

Bibliografía Básica

- **GREENE, W.H.: Análisis econométrico, Ed. Prentice Hall (set. 1998)**
- **GUJARATI, D.N.: Econometria, Ed. McGraw-Hill, México (1997)**
- **JOHNSTON, J.: Métodos de Econometría, Ed. Vicens Vives, Barcelona (1987)**
- **KMENTA, J.: Elementos de Econometría, Ed. Vicens Vives, Barcelona (1980)**
- **NOVALES, A.: Econometría, Ed. McGraw-Hill, Madrid (1993)**
- **NOVALES, A.: Estadística y Econometría, Ed. McGraw-Hill, Madrid (1997)**
- **OTERO, J.M.: Econometría. Series Temporales y Predicción. Ed. AC, Madrid (1993)**

Bibliografía Complementaria

- **AZNAR, GARCIA Y MARTIN: Ejercicios de Econometría, Ed. Pirámide, Madrid (1994)**
- **FERNANDEZ SAINZ, A.I. et al.: Ejercicios de Econometría, Ed. McGrawHill, Madrid (1995)**
- **PULIDO, A.: Modelos Econométricos, Ed. Pirámide, Madrid (1989)**
- **URIEL, E. et al.: Econometría: El modelo lineal, Ed. AC, Madrid (1990)**
