

Assignatura: **ECONOMETRIA I**
Codi: **16042024** Crèdits: **6**
Tipus: **Troncal** Cicle: **2n** Curs: **3r** Quadrimestre: **1r**
Departament: **Economia**
Àrea: **Economia Aplicada**
Professorat: **Juan Manuel López-Rey, Miquel Manjón**

Objectius generals:

Desenvolupament del model de regressió lineal múltiple clàssic o normal. Versió matricial.
Estimació dels paràmetres per MQO.
Anàlisi de les conseqüències de la relaxació d'alguna de les hipòtesis del model estàndard.

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.

Assignatures que es recomana haver cursat prèviament/simultàniament:

Estadística I i II, Matemàtiques Empresarials I i II.

Assignatures en les quals s'apliquen els continguts d'aquesta:

Entre altres: Microeconomia Superior, Macroeconomia II, Teoria dels Mercats Financers...

Bibliografia bàsica:

Greene, W. H. *Análisis econométrico*. Ed. Prentice Hall, 1998.
Gujarati, D. N. *Econometría*. Ed. McGraw-Hill, 1997.
Johnston, J. *Métodos de Econometría*. Ed. Vicens Vives, 2001.
Novales, A. *Econometría*. Ed. McGraw-Hill, 1993.
Novales, A. *Estadística y Econometría*. Ed. McGraw-Hill, 1997.

Bibliografia complementària:

Aznar; Garcia; Martin. *Ejercicios de Econometría*. Ed. Pirámide, 1994.
Fernandez Sainz, A. I. [et al.]. *Ejercicios de Econometría*. Ed. Mc.Graw-Hill, 1995.
Kmenta, J. *Elementos de Econometría*. Ed. Vicens Vives, 1980.
Otero, J. M. *Econometría. Series Temporales y Predicción*. Ed. AC, 1993.
Pulido, A. *Modelos Económicos*. Ed. Pirámide, 1989.
Uriel, E. [et al.]. *Econometría: El modelo lineal*. Ed. AC, 1990.

Programa:

- 1. El model estàndard de regressió lineal simple. Estimació MQO**
- 2. Model estàndard de regressió lineal múltiple. Versió matricial. Estimació MQO**
- 3. Restriccions sobre els paràmetres del model de regressió múltiple estàndard**
- 4. Relaxació de les hipòtesis bàsiques**
- 5. Heteroscedasticitat**
- 6. Autocorrelació**
- 7. Problemes amb la informació mostral**
- 8. Errors d'especificació**
- 9. Variables exògenes qualitatives**