

Assignatura: **ECONOMETRIA I**
Codi: **16042024** Crèdits: **6**
Tipus: **Troncal** Cicle: **2n** Curs: **3r** Quadrimestre: **1r**
Departament: **Economia**
Àrea: **Economia Aplicada**
Professorat: **Vacant, T.Corbella, C.Domingo, M.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. *Econometria*. Ed. McGraw-Hill, 2004.
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 Y 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