

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  $\beta$ .
  - 2.2.5. Estimación de  $\sigma^2$  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.