

Econometria (2004/05)

Programa

1. El modelo lineal simple (de dos variables)
2. El modelo lineal de k variables
3. La inferencia y restricciones en el modelo MCO
4. Variables ficticias
5. Errores de especificación
6. Multicolinealidad
7. Modelos de mínimos cuadrados generalizados (MCG)
8. Estimadores de máxima verosimilitud
9. Método de momentos generalizados (MMG)

Prácticas se realizarán en la aula de ordenadores, utilizando el programa Eviews.

La evaluación: Examen (80% de nota) y dos ejercicios (20% de nota)

Bibliografía:

- Berndt, E.R.**, '*The Practice of econometrics*', Addison-Wesley, 1991
- Fernández, M.D. y Llorente Marrón, M^a. del Mar**, '*Econometría*', Ediciones Pirámide, 2003
- Gujarati, D.**, '*Econometría*', McGraw-Hill, 1992
- Johnston, J.**, '*Métodos de econometría*', Vicens-Vives, 1987
- Maddala, G.S.**, '*Introducción a la econometría*', Prentice-Hall, 1996
- Novales, A.**, '*Econometría*', McGraw-Hill, 1993
- Pena Trapero, J.B., Estavillo Dorado, J.A., Galindo Frutos, M.E., Leceta Rey, M.J. y Zamora Sanz, M^a del Mar**, '*Cien ejercicios de econometría*', Ediciones Pirámide, 1999