

Econometría

Horario	Aula
Martes 15:00-17:00	Aula de ordenadores
Miércoles 15:00-17:00	C5/026

Profesor	Helmuts Azacis
Despacho	B3-112-E
Teléfono	93 581 1813
E-mail	hazacis@idea.uab.es
Página web	http://idea.uab.es/~hazacis/
Horario de consultas	Martes, Miércoles 17:15-18:15

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