

Programa de Mètodes Economètrics
Prof.: A. Calero, M. Farell i J.Ll. Raymond
Curs 1995-96

1) Alguns tòpics del model de regressió

- 1.1. Errors d'especificació i selecció de models.
- 1.2. Variables fictícies i aplicacions.

2) Mínims quadrats generalitzats

- 2.1. Definició estimador.
- 2.2. Autocorrelació.
- 2.3. Heterocedasticitat.
- 2.4. Sistemes d'equacions.

3) Models dinàmics

- 3.1. Retards variables exògens.
- 3.2. La variable endògena desfasada.

4) Models simultanis

- 4.1 Formes estructural i reduïda.
- 4.2. El problema de la identificació.
- 4.3. El problema de l'estimació.

Bibliografia

Johnston, J. (1987): Métodos de econometría. 3a. edició. Vicens Vives.

Gujarati, D.N. (1990): Econometría. 2a. edició. McGraw-Hill.

Aznar, A. i García Ferrer, A. (1990): Problemas de Econometría. 3a. edició. Editorial Pirámide.

Pindyck, R. i Rubinfeld, D. (1980): Modelos Econométricos. Editorial Labor.

Raymond, J.L. i Uriel, E. (1987): Investigación econométrica aplicada: un caso de estudio. Editorial AC.