

TEMES D'ECONOMETRIA

4º Curs (2º semestre)

Prof: C. Pinyol

1. Teoria asimptòtica

Tipus de convergència: Convergència en probabilitat, convergència en mitjana quadràtica, convergència en distribució.

Distribucions asimptòtiques en el model de regressió clàssic.

2. Màxima versemblança i tests associats.

El mètode de màxima-versemblança. Propietats asimptòtiques de l'estimador M.V. Algoritmes de càlcul per a la sol·lució d'un problema d'òptimització no lineal: El mètode de Newton, mètode de "scoring".

Tests, associats a l'estimació M.V. , asimptòticament equivalents: El Test de la rao de versemblança, Test de Wald i el Test del Multiplicador de Lagrange. Exemples.

3. Models d'elecció discreta.

Models d'elecció binària. Estimació i Inferència en els models d'elecció binària. Models Logit i models Probit bivariants.

4. Models d'equacions simultànies

Sistema d'equacions il·lustratiu. Especificació del model d'equacions simultànies. Formes estructural i reduïda.

El problema de la identificació. Identificació mitjançant restriccions d'exclusió.

Estimació: Mínims quadrats ordinaris i sistemes triangulars, Mínims quadrats indirectes, Estimació per variables instrumentals (VI), Mínims quadrats en dues etapes (2SLS), L'estimador M.V. amb informació limitada (LIML), Mínims quadrats en tres etapes, L'estimador de M.V. amb informació completa.

Comparació de mètodes.

5. Models de regressió no-lineals

Especificació no lineal. Aproximació lineal al model no lineal.

Estimació de mínims quadrats no lineal. Estimació de M.V.

Tests d'hipòtesis i restriccions paramètriques: Wald, Rao de versemblança i multiplicadors de Lagrange.

BIBLIOGRAFIA

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

Kmenta, J. (1980): Elementos de econometría. 2ª ed. Ed. Vicens Vives

Madala. Introduction to Econometrics (Second Edition) Editorial Macmillan Publishing Company

William H. Greene. Econometric Analysis (Second Edition). Editorial Macmillan Publishing Company.

Horari de Tutories:

Dimarts de 12h. a 13:30h.

Dijous de 12h. a 13:30h.