

Programa de Mètodes Economètrics .  
Prof.: Conxita Pinyol  
Curso 1996-1997

El modelo de regresión.

**1. Mínimos cuadrados generalizados.**

- 1.1 Causas de perturbaciones no esféricas.
- 1.2 El estimador mínimo cuadrado generalizado: Definición, Propiedades.
- 1.3 El problema de la autocorrelación: Detección y contraste, estimación.
- 1.4 El problema de la heteroscedasticidad: Detección y contraste, estimación.
- 1.5 Sistemas de ecuaciones.

**2. Modelos dinámicos.**

- 2.1 Introducción.
- 2.2 Modelos de retardos infinitos: El modelo de Koyck.
- 2.3 Modelos de retardos finitos: El modelo de Almon.
- 2.4 Estimación.

Modelos simultáneos.

**3. Introducción.**

- 3.1 Concepto de modelo de ecuaciones simultáneas.
- 3.2 Formas estructural y reducida.
- 3.3 Problemas planteados por los modelos simultáneos.

**4. Identificación y estimación.**

- 4.1 Concepto de identificación y condiciones para la misma.
- 4.2 El método de las variables instrumentales.
- 4.3 Otros métodos de estimación.

Bibliografía

**Johnston, J.** (1987): Métodos de econometría. 3<sup>a</sup> edición. Vicens Vives.

**Gujarati, D.N.** (1990): Econometría. 2<sup>a</sup> edición. McGraw-Hill.

**Aznar A. y García Ferrer, A.** (1990): Problemas de econometría. 3<sup>a</sup> ed. Ed. Pirámide.

**Kmenta, J.** (1980): Elementos de econometría. 2<sup>a</sup> ed. Ed. Vicens Vives

**Pindyck R. y Rubinfeld D.** (1980): Modelos econométricos. Ed. Labor.

**Horario de tutorías:** Miércoles de 12 a 13<sup>30</sup>h.

Viernes de 12 a 13<sup>30</sup>h.