

Programa de Mètodes Econòmètrics .

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. 3ª edición. Vicens Vives.

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

Aznar A. y García Ferrer, A. (1990): Problemas de econometría. 3ª ed. Ed. Pirámide.

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

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

Horario de tutorías: Miércoles de 12 a 13³⁰h.

Viernes de 12 a 13³⁰h.