

Mètodes Economètrics

Prof. Michael Creel

Curs 96/7

Programa

1. Mínims quadrats generalitzats

- (a) Definició de l'estimador
- (b) Autocorrelació
- (c) Heteroscedasticitat
- (d) Sistemes d'equacions

2. Models dinàmics

- (a) Retards distribuïts
- (b) La variable endògena retardada

3. Equacions simultànies

- (a) Formes estructural i reduïda
- (b) Identificació
- (c) Estimació

Manualets de consulta

Gujarati, D.N., *Econometria*, Segona Edició, McGraw-Hill.

Kmenta, J. *Elementos de Econometria*, Segona Edició, Vicens Vives.

Johnston, J. *Métodos de Econometria*, Tercera Edició, Vicens Vives.

Novalés, *Econometria*, Segona Edició. McGraw-Hill.

Requeriments del curs:

Opció 1: 90% examen i 10% treballs (n'hi haurà 3).

Opció 2: 100% examen

No es guarden notes.

Oficina i Hores de consulta

B3-198

Hores per anunciar al començament de classes