

Assignatura-Codi

**Mètodes Economètrics**

22287

02

Curs acadèmic	Cicle	Quadrimestre
1997/98	2	febrer-juny

Grup/s	Professors	Despatx	Telèfon Despatx
02 i 52	Josep Lluís Raymond	B3-144	581-1711

## PROGRAMA

### DESCRIPTOR OFICIAL DE L'ASSIGNATURA

Mínims quadrats generalitzats, variables instrumentals, models dinàmics i introducció a l'anàlisi de sèries temporals i als models d'equacions simultànies.

### TEMARI DETALLAT DELS CONTINGUTS

#### **Algunos tópicos del modelo de regresión**

Multicolinealidad  
Errores de especificación y selección de modelos  
Variables ficticias y estacionalidad

#### **Mínimos Cuadrados Generalizados**

Definición del estimador  
Autocorrelación  
Heteroscedasticidad  
Sistemas de ecuaciones

#### **Modelos dinámicos**

Justificación económica  
Retardos de las variables exógenas  
Retardos de la variable endógena

#### **Modelos simultáneos**

Concepto  
Identificación  
Estimación

### CALENDARI APROXIMAT


### Bibliografia

Johnston, J. (1987), "*Métodos de la econometría*", Edit. Vicens Vives

Kmenta, J. (1980), "*Elementos de econometría*", Edit. Vicens Vives

Raymond, J. L. y Uriel, E. (1987), "*Investigación econométrica aplicada*", Edit. A.C.

### HORES TUTORIES

PROFESSOR	HORARI TUTORIES
Josep Lluís Raymond	Dimarts: 12:00 - 13:30