

Assignatura-Codi

Mètodes Econòmètrics

22287

63

Curs acadèmic	Cicle	Quadrimestre
1997/98	2	febrer-juny

Grup/s	Professors	Despatx	Telèfon Despatx
03 i 53	Maite Cabeza	B3-164	581-2195

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

I: EL MODEL DE REGRESSIO LINEAL GENERALITZAT

1. Introducció al model de regressió lineal generalitzat
2. Heteroscedasticitat
3. Autocorrelació
4. Sistemes d'equacions

II: MODELS DINAMICS

5. Models de retards finits i infinits

III: SISTEMES SIMULTÀNIS D'EQUACIONS

6. Introducció als sistemes d'equacions simultànies

Manuels de consulta:

Gujarati, D.N. (1990), *Econometria*. Segona Edició McGraw-Hill.
Pindyck, R. i D. Rubinfeld (1980) *Modelos Econòmètrics*. Labor.
Kmenta, J. *Elementos de Econometria*. Segona edició. Vicens Vives.
Johnston, J. (1987), *Métodos de Econometria*. Tercera Edició. Vicens Vives.

Avaluació:

opció 1: nota curs = nota examen . 90% + nota exercicis . 10%
opció 2: nota curs = nota examen

HORES TUTORIES

PROFESSOR	HORARI TUTORIES
Maite Cabeza	Dilluns: 10:30 - 12:00
	Dijous: 15:00 - 16:30