

# Econometria II

## Objectius:

El curs ha de garantir els objectius següents:

- Estudiar en el Model de Regressió amb regressors estocàstics, els seus propòsits, mètodes d'estimació i propietats dels estimadors.
- Estudiar Models de Regressió Lineal amb variables retardades.
- Estudiar el Problema de l'Identificació i Estimació dels Models d'Equacions Simultànies.

## Programa:

### 1. Altres Proves de Diagnòstic.

- 1.1 Proves addicionals d'heteroscedascitat.
- 1.2 Proves addicionals d'autocorrelació.
- 1.3 Mètode de Zellner.

### 2. El model de Regressió lineal amb regressors estocàstics.

- 2.1 Introducció.
- 2.2 El model i els seus supòsits.
- 2.3 Mètode de Variables Instrumentals.

### 3. El model de Regressió lineal amb variables retardades.

- 3.1 Introducció als models dinàmics.
- 3.2 Especificació i estudi de Models Dinàmics.
- 3.3 Estimació de Models Dinàmics.

### 4. Sistema d'equacions simultànies.

- 4.1 Introducció. Forma estructural i forma reduïda.
- 4.2 El problema de la identificació.
- 4.3 El problema de l'estimació.

## Bibliografia:

- A. Aznar, A. Garcia: "Problemas de econometría". Vicens-Vives (1990).
- D. N. Gujarati: "Econometría". McGraw-Hill (1997).
- J. Johnston: "Métodos de econometría". Vicens-Vives (1987).
- G. S. Maddala: "Introducción a la econometría". Prentice-Hall (1996).
- R. Pindyck, D. Rubinfeld: "Modelos econometricos". Labor (1980).