

PROGRAMA DE ECONOMETRÍA SEGUNDO SEMESTRE

Prof. J. L. Raymond

Curso 1999-2000

I) Algunos tópicos del modelo de regresión

Errores de especificación

Selección de modelos

II) Mínimos Cuadrados Generalizados

Definición del estimador

Autocorrelación

Heteroscedasticidad

III) Modelos dinámicos

Retardos de las variables exógenas

Retardos de la variable endógena

IV) Modelos simultáneos

Concepto

Identificación

Estimación

Bibliografía

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

Kmenta, J (1980), Elementos de econometría, Vicens Vives

Raymond, J. L. y Uriel, E, Investigación econométrica aplicada, Alfa-Centauro