

I. CONCEPTES PREVIS

1. El model de regressió lineal
2. Propietats dels estimadors
 - 2.1. Propietats dels estimadors en mostres petites
 - 2.2. Propietats dels estimadors en mostres grans
3. Mètodes d'estimació
 - 3.1. Estimació per mínims quadrats
 - 3.2. El mètode de la màxima versemblança

II. VIOLACIONS DELS SUPOSITS BASICS

4. Multicolinearitat
 - 4.1. Introducció
 - 4.2. Efectes introduïts per la multicolinearitat
 - 4.3. Com detectar el grau de multicolinearitat
 - 4.4. Tractament de la multicolinearitat
5. Heteroscedasticitat
 - 5.1. Introducció
 - 5.2. Efectes introduïts per l'heteroscedasticitat
 - 5.3. Com detectar la presència d'heteroscedasticitat
 - 5.4. Mínims quadrats generalitzats
 - 5.5. Mínims quadrats generalitzats factibles
6. Autocorrelació
 - 6.1. Introducció
 - 6.2. El procés autoregressiu
 - 6.3. El procés de mitjanes mòvils
7. Errors d'especificació
 - 7.1. Omissió de variables rellevant
 - 7.2. Inclusió de variables irrellevant

III. ESTIMACIO DE MODELS ESPECIALS

8. Estimació amb restriccions
 - 8.1. Introducció
 - 8.2. Restriccions lineals
 - 8.3. Restriccions no lineals
9. Regressions amb variables fictícies
 - 9.1. Introducció
 - 9.2. Aplicacions: contrast de canvi estructural
 - 9.3. Aplicacions: ajust estacional de sèries temporals

- 10. Models d'elecció discreta
 - 10.1. Introducció
 - 10.2. El model lineal de probabilitat
 - 10.3. El model de logit
 - 10.4. El model de probit
- 11. Models dinàmics
 - 11.1. Introducció
 - 11.2. Models amb retards geomètrics
 - 11.3. Models amb retards polinòmics
- 12. Combinació de dades de tall transversal i series temporals
 - 12.1. Introducció
 - 12.2. Model heterocedastic-autoregressiu
 - 12.3. Models de covariança
 - 12.4. Models d'efectes aleatoris
- 13. Models d'equacions aparentment no relacionades
 - 13.1. Introducció
 - 13.2. Estimació del sistema

IV. SISTEMES SIMULTANIS D'EQUACIONS

- 14. Models d'equacions simultànies
 - 14.1. Introducció als SSE
 - 14.2. Notació i terminologia dels SSE
 - 14.3. Tipus de sistemes
- 15. El problema de la identificació
 - 15.1. Presentació del problema
 - 15.2. La introducció de restriccions
 - 15.3. Mètodes per determinar l'estatus d'identificació
- 16. Mètodes d'estimació
 - 16.1. Introducció
 - 16.2. Mètodes d'estimació limitats
 - 16.3. Mètodes d'estimació complets

Referències bibliogràfiques:

- Gujarati, G. (1990) *Econometria*, McGraw-Hill. Segona edició
- Pindyck, R. & D.L. Rubinfeld (1980) *Modelos Econometricos y Previsión Económica*, Labor Universitaria.
- Kmenta, J. (1980), *Elementos de Econometria*, Vicens Vives
- Johnston, J. (1987), *Métodos de Econometria*, Vicens Vives
- Novalés, A. (1989) *Econometria*, McGraw-Hill

Calendari:

Primer semestre temes 1-10

Segon Semestre temes 11-16

Requeriments del curs:

Per passar el curs és necessari la realització, amb l'ajut d'un ordinador, de 8 exercicis pràctics i dos exàmens parcials. El pes de cadascun d'aquests requeriments en la qualificació final és d'un 40 i 60 per cent respectivament.

Horari de tutories:

Dilluns 16.30-17.55

Dimecres 10.30-12.00