

Objectius:

El curs ha de garantir els objectius següents:

- Estudiar en detall el Model Lineal General, els seus supòsits, els mètodes d'estimació, les propietats dels estimadors, els contrastos d'hipòtesis i els pronòstics.
- Ampliar l'estudi del Model de Regressió Lineal General per el cas de restriccions lineals en el paràmetres.
- Ampliar l'estudi del Model de regressió Lineal General en el cas que existeixin regressors qualitius.
- Estudiar els contrastos per a la verificació de cadascun dels supòsits del Model.
- Estudiar el Model de Regressió Lineal Generalitzat, els seus supòsits i mètodes d'estimació.

Programa:

1. El Model de Regressió Lineal General.

- 1.1 El Model i els seus supòsits.
- 1.2 Estimadors M.C.O.
- 1.3 Inferència en el Model de Regressió Lineal General.
- 1.4 El Model de Regressió amb restriccions lineals.

2. Altres tòpics del Model Lineal de k variables.

- 2.1 Contrastos de canvi estructural.
- 2.2 El Model de Regressió amb variables fictícies.
- 2.3 Correcció estacional.
- 2.4 Multicolinealitat.
- 2.5 Errors d'especificació.

3. El Model de Regressió Lineal Generalitzat.

- 3.1 Definició del model. Els seus supòsits.
- 3.2 Estimador de mínims quadrats generalitzat.
- 3.3 El problema de la heteroscedasticitat: detecció, contrastos i estimació.
- 3.4 El problema de l'autocorrelació: detecció, contrastos i estimació.
- 3.5 Sistemes d'equacions.

Bibliografia

- 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).
- A. Novales: "Econometría". McGraw-Hill (1993).
- R. Pindyck, D. Rubinfeld: "Modelos econométricos". Labor (1980).