

## TEMARIO ECONOMETRIA DE LA EMPRESA

### 1. El model de regressió lineal múltiple (MRLM): especificació i inferència estadística

#### 1.1. Anàlisi de l'MRLM: les seves propietats estadístiques

- a) Formulació i hipòtesis bàsiques
- b) Estimació
- c) Mesures de bondat de l'ajustament
- d) Anàlisi de la variància
- e) Interpretació de resultats

#### 1.2. Formulació de contrastos d'hipòtesi. Validació de l'MRLM

- a) Contrastos d'hipòtesi sobre els paràmetres
- b) Predicció puntual i per interval. Mesures de capacitat predicativa
- c) Estimació restringida
- d) Contrastos de canvi estructural, linealitat i normalitat

#### 1.3. Tractament de l'MRLM amb problemes en la informació mostral: dades atípiques (*outliers*) i multicol·linealitat

- a) *Outliers* i observacions influents
- b) Principals contrastos i indicadors de dades atípiques
- c) Multicol·linealitat: definició, graus i conseqüències en l'estimació per mínims quadrats ordinaris (MQO)
- d) Detecció, valoració i solucions de la multicol·linealitat

### 2. Extensions i ampliacions de l'MRLM

#### 2.1. Tractament de la informació qualitativa en el context de l'MRLM

- a) Especificació del model de regressió amb variables exògenes fictícies
- b) Estimació per mínims quadrats ordinaris (MQO)
- c) Interpretació dels paràmetres
- d) Utilització de variables fictícies en el contrast de canvi estructural

#### 2.2. L'MRLM sota els supòsits d'heteroscedasticitat

- a) Pertorbació no esfèrica: conseqüències en l'estimació MQO
- b) L'estimador per mínims quadrats (MQ) generalitzats
- c) Contrastos d'heteroscedasticitat

#### 2.3. Omissió, errors i endogenitat en les variables explicatives de l'MRLM

- a) L'estimador per variables instrumentals (VI)
- b) L'estimador per mínims quadrats en dues etapes (MQ2E)
- c) Contrastos d'endogenitat

#### 2.4. El model lògit de respostes binàries

- a) Especificació del model lògit
- b) Estimació per màxima versemblança
- c) Interpretació de les estimacions

