

**DEPARTAMENTO DE ANÁLISIS ECONÓMICO**

**PROGRAMA DE ECONOMETRÍA.**

*HOMOLOGACIÓN DEL TÍTULO DE LICENCIADO EN ECONOMÍA*

## **Bibliografía**

Gujarati (1996) *Econometría*. (3ª edición) McGraw Hill

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

Novales (1993). *Econometría*. McGraw Hill

Uriel E., Contreras, D., Molto, M. L. y Peiró (1990) *Econometría: El modelo lineal*. AC.

## **SUMARIO**

### **Tema 1. El modelo lineal general.**

- 1.1. Características del modelo.
- 1.2. Estimación por mínimos cuadrados ordinarios (MCO)
- 1.3. Propiedades derivadas del método de estimación de MCO.
- 1.4. Correlación vs. causalidad.
- 1.5 Establecimiento de hipótesis.
- 1.6 Propiedades de los estimadores: En muestras finitas y propiedades asintóticas.  
Teorema de Gauss-Markov.

*Bibliografía Básica.*

Gujarati Cap., 7, Uriel et al., Cap. 3, Johnston, Cap. S.

### **Tema 2. Inferencia en el modelo lineal general**

- 2.1. Supuesto de normalidad y su contrastación empírica.
- 2.2. Distribuciones derivadas de la normal.
- 2.3. Distribuciones en la regresión.
- 2.4. Estimadores de máxima verosimilitud.

*Bibliografía Básica.*

Gujarati Cap., 7, Uriel et al., Cap. 4. Johnston, Cap. 7.

### **Tema 3. Contraste de hipótesis en el modelo lineal general**

- 3.1. El estadístico F.
- 3.2. Aplicación a casos concretos.
- 3.3. Contraste de hipótesis mediante la suma de cuadrados de los residuos.
- 3.4 Test de cambio estructural

*Bibliografía Básica.*

Gujarati Cap., 7, Uriel et al., Cap. 5 Johnston, Caps. 5 y 6.

#### **Tema 4. Predicción en el modelo lineal general**

- 4.1. Introducción.
- 4.2. Error de predicción y varianza.
- 4.3. Intervalo de confianza de la predicción.
- 4.4. Evaluación y contraste de la capacidad predictiva de un modelo.

*Bibliografía Básica.*

Gujarati Cap., 7, Johnston, Cap. 5

#### **Tema 5. Multicolinealidad.**

- 5.1. Consecuencias teóricas de la multicolinealidad.
- 5.2. Formas de detectar el problema.
- 5.3. Soluciones.

*Bibliografía Básica.*

Gujarati Cap. 8, Uriel et al., Cap. 7. Johnston, Cap. 6.

#### **Tema 6. Regresión con variables ficticias.**

- 6.1. Introducción.
- 6.2. Utilización y significado de las variables ficticias.
  - 6.2.1. Introducción de una variable ficticia en forma aditiva.
  - 6.2.2. Introducción de más de una variable ficticia en forma aditiva.
  - 6.2.3. La trampa de las variables ficticias.
- 6.3. Variables ficticias y cambio estructural.
- 6.4. Variables ficticias y efecto interacción.

*Bibliografía Básica.*

Gujarati Cap. 12 y 13, Uriel et al. Cap. S. Johnston, Cap. 6.

#### **Tema 7. Heterocedasticidad y mínimos cuadrados generalizados.**

- 7.1. Causa de las perturbaciones no esféricas.
- 7.2. Propiedades de los estimadores por MCO con perturbaciones no esféricas.
- 7.3. Estimador de mínimos cuadrados generalizados.
- 7.4. El problema de la heteroscedasticidad. Forma de detectarla y estimación en presencia de heteroscedasticidad.

*Bibliografía Básica.*

Johnston Cap. 8, Uriel et al., Caps. 9 y 10. Johnston, Cap. 8.

#### **Tema 8. Perturbaciones no esféricas II: Autocorrelación.**

- 8.1. Definición y naturaleza.
- 8.2. Esquema AR(I) para las perturbaciones: Formas de detectar el problema y posibles soluciones.
- 8.3. Generalización a esquemas de otros órdenes y características.

*Bibliografía Básica.*

Gujarati Cap. 10, Uriel et al., Cap. 11 Johnston, Cap. 8

**Tema 9. Especificación del modelo.**

9.1. Atributos de un buen modelo.

9.2. Errores de especificación.

9.2.1. En la forma funcional.

1 1.2.2. En la omisión de variables relevantes.

1 1.2.3. Inclusión de variables irrelevantes.

9.3. Pruebas para detectar errores de especificación.

*Bibliografía Básica.*

Gujarati (1990) Cap. 11

**Tema 10.- Variables dependientes cualitativas**

10.1. Modelos de elección discreta

10.2. Modelo lineal de probabilidad

10.3 Modelos Logit y Probit

10.4 Inferencia en los modelos de elección discreta.

*Bibliografía Básica.*

,Gujarati (1996), Caps. 15, 16. Novales Cap. 16, parte 1. Johnston, Cap.10.