

Plan 300 Lic.Admon.y Dirección Empresas

Asignatura 43644 **ECONOMETRIA**

Grupo 1

Presentación

Programa Básico

Objetivos:

Se pretende que el alumno al finalizar el curso sea capaz de:

- Conocer el papel de la Econometría en la Economía.
- Conocer los elementos básicos para especificar, contrastar y predecir en un modelo de regresión múltiple.
- Adquirir las habilidades básicas para el desarrollo de la Econometría teórica en el contexto de un modelo de regresión múltiple.
- Aplicar los procedimientos teóricos a situaciones prácticas, al mismo tiempo que interpretar de forma crítica los resultados obtenidos.
- Conocer y aplicar los procedimientos del programa informático Eviews para estimar, contrastar y predecir en un modelo de regresión múltiple.

PROGRAMA

- Tema 1: El modelo de regresión lineal clásico I
Formulación e hipótesis, estimación y propiedades del estimador MCO
Estimadores máximo verosímiles de los parámetros. Propiedades
- Tema 2: El modelo de regresión lineal clásico II
Mínimos cuadrados con restricciones. Propiedades del estimador restringido
Contrastes de restricciones lineales sobre los parámetros
- Tema 3: Predicción
- Tema 4: Variables ficticias
- Tema 5: Errores de especificación
- Tema 6: Multicolinealidad
- Tema 7: Modelo de regresión lineal generalizado
- Tema 8: Heteroscedasticidad
- Tema 9: Autocorrelación
- Tema 10: Regresores estocásticos
- Tema 11: Modelos dinámicos
- Tema 12: Introducción a los modelos de ecuaciones simultáneas

Bibliografía básica

- ALONSO, A. (2004). "Econometría". Ed. Pearson.
- GUJARATI, D. (1990). "Econometría". Ed McGraw-Hill. 2ª Edición. Bogotá
- JOHNSTON, J. y DINARDO, J.(2001). "Métodos de Econometría". Vicens-Vives.
- NOVALES, A. (1993). "Econometría". Ed. McGraw-Hill
- ALEGRE, J. y otros (1995), "Ejercicios y Problemas de Econometría". Ed. AC.
- CARRASCAL ARRANZ, U. y otros (2000), "Análisis Económico con EViews". Ed. Ra-Ma.
- FERNÁNDEZ SÁINZ, A. y otros. (1995), "Ejercicios de Econometría". Ed. McGraw-Hill.
- PENA, B. y otros (1999). "Cien Ejercicios de Econometría". Ed. Pirámide.

Objetivos

Tema 1: El modelo de regresión lineal clásico I

- 1.1 Formulación e hipótesis del modelo
- 1.2 Estimación del modelo. Método de mínimos cuadrados
- 1.3 Propiedades del estimador MCO del vector paramétrico
- 1.4 Estimación de la varianza de la perturbación
- 1.5 Características de los residuos mínimo cuadráticos
- 1.6 Descomposición de la varianza. Coeficiente de determinación y coeficiente de determinación ajustado
- 1.7 Estimadores máximo verosímiles de los parámetros. Propiedades
- 1.8 Otras medidas de bondad de ajuste
- 1.9 Regresión particionada

Tema 2: El modelo de regresión lineal clásico II

- 2.1 Mínimos cuadrados con restricciones. Propiedades del estimador restringido
- 2.2 Contrastes de restricciones lineales sobre los parámetros. Forma general
- 2.3 Contrastes de restricciones lineales sobre los parámetros. Casos particulares
- 2.4 Contrastes LR, W y LM

Tema 3: Predicción

- 3.1 Predicción
- 3.2 Contrastes e intervalos de confianza para los valores medio y futuro del regresando
- 3.3 Evaluación de la capacidad predictiva de un modelo

Tema 4: Variables ficticias

- 4.1 Introducción
- 4.2 Formas de introducir un factor cualitativo en el modelo de regresión
- 4.3 Formas de introducir varios factores cualitativos en el modelo de regresión

Tema 5: Errores de especificación

- 5.1 Introducción
- 5.2 Error de especificación por inclusión y omisión de regresores
- 5.3 Errores de especificación en la forma funcional
- 5.4 Contrastes sobre la estabilidad de los parámetros. Contraste de Chow y estimación recursiva
- 5.5 No normalidad

Tema 6: Multicolinealidad

- 6.1 Ortogonalidad versus multicolinealidad perfecta
- 6.2 Consecuencias de la multicolinealidad imperfecta
- 6.3 Procedimientos para detectar la multicolinealidad
- 6.4 Soluciones a la multicolinealidad

Tema 7: Modelo de regresión lineal generalizado

- 7.1 Formulación del modelo
- 7.2 Consecuencias de aplicar MCO en un modelo de regresión lineal generalizado
- 7.3 Estimador de mínimos cuadrados generalizados o de Aitken
- 7.4 Propiedades del estimador de Aitken
- 7.5 Estimador insesgado de 2 en el modelo de regresión generalizado
- 7.6 Estimador factible
- 7.7 Comparación entre estimadores. Contrastes y bondad del ajuste

Tema 8: Heteroscedasticidad

- 8.1 Heteroscedasticidad. Planteamiento general
- 8.2 Procedimientos para detectar la heteroscedasticidad
- 8.3 Estimación del modelo y predicción

Tema 9: Autocorrelación

- 9.1 Planteamiento general.
- 9.2 Procedimientos para detectar la autocorrelación
- 9.3 Estimación del modelo
- 9.4 Predicción
- 9.5 Identificación de los esquemas

Tema 10: Regresores estocásticos

- 10.1 Posible carácter estocástico de las variables explicativas
- 10.2 Variables contemporáneamente exógenas y estrictamente exógenas
- 10.3 Propiedades de los estimadores de Mínimos Cuadrados Ordinarios en modelos con regresores estocásticos

10.4 Modelos con variables estocásticas correlacionadas con la perturbación. Método de variables instrumentales
10.5 Errores en las variables
10.6 Test de exogeneidad

Tema 11: Modelos dinámicos

11.1 Planteamiento general

11.2 Modelos autorregresivos

11.3 Modelos con retardos distribuidos o escalonados. Estructura finita e infinita de retardos

Tema 12: Introducción a los modelos de ecuaciones simultáneas

12.1 Planteamiento del problema

12.2 El problema de la identificación

12.2 Problemas de estimación

Programa Práctico

Evaluación

Bibliografía
