

Programa de Econometría I.

Prof.: J.Ll. Raymond

4º curso general

Curso 1993-1994

I Introducción a la econometría.

1. La naturaleza de la econometría.

- 1.1 Econometría: una definición.
- 1.2 Relaciones entre las variables económicas: identidades y relaciones de comportamiento.
- 1.3 Modelos uniecuacionales y modelos simultáneos.
- 1.4 Modelos matemáticos y modelos econométricos. El concepto de perturbación aleatoria.
- 1.5 Modelos estáticos y modelos dinámicos.
- 1.6 Econometría teórica y econometría empírica.
- 1.7 La información estadística.

2. El modelo lineal de dos variables.

- 2.1 La especificación lineal y el estimador M.C.O.
- 2.2 Coeficientes de correlación y de determinación.
- 2.3 Propiedades de los estimadores.
- 2.4 Predicción.

II El modelo de regresión.

3. El modelo lineal de k variables.

- 3.1 Hipótesis de partida.
- 3.2 Estimadores M.C.O..
- 3.3 Inferencia en el modelo de regresión.

4. Otros tópicos del modelo de k variables.

- 4.1 Estimación con restricciones.
- 4.2 Contrastes de cambio estructural.
- 4.3 Variables ficticias.
- 4.4 Corrección estacional.
- 4.5 Multicolinealidad.
- 4.6 Errores de especificación.

5. Mínimos cuadrados generalizados.

- 5.1 Causas de perturbaciones no esféricas.
- 5.2 Definición del estimador.
- 5.3 Autocorrelación.
- 5.4 Heteroscedasticidad.
- 5.5 Sistemas de ecuaciones.

6. Modelos dinámicos.

- 6.1 Justificación económica.
- 6.2 Retardos de las variables exógenas.
- 6.3 La variable endógena desfasada.

III Análisis de series temporales

7. Consideraciones previas.

- 7.1 Métodos de previsión en econometría.
- 7.2 Procesos estocásticos.
- 7.3 Procesos lineales.

8. Modelos lineales.

- 8.1 Modelos autorregresivos.
- 8.2 Modelos de media móviles.
- 8.3 Modelos mixtos.
- 8.4 Procesos estacionarios.

9. Elaboracion de modelos ARIMA.

- 9.1 Identificación.
- 9.2 Estimación.
- 9.3 Validación.
- 9.4 Predicción.
- 9.5 Modelos estacionales.

IV Modelos simultáneos.

10. Introducción.

- 10.1 Concepto de modelo de ecuaciones simultáneas.
- 10.2 Formas estructural y reducida.
- 10.3 Problemas planteados por los modelos simultáneos.

11. Identificación y estimación.

- 11.1 Concepto de identificación y condiciones para la misma.
- 11.2 El método de las variables instrumentales.
- 11.3 Otros métodos de estimación.
- 11.4 Simulación.

Bibliografía

I. Básica:

Johnston, J. (1987): Métodos de econometría. 3ª edición. Vicens Vives.

Uriel, E. (1985): Análisis de series temporales. Modelos ARIMA. Ed. Paraninfo.

II. Complementaria:

Aznar A. y García Ferrer, A. (1990): Problemas de econometría. 3ª ed. Ed. Pirámide.

Kmenta, J. (1980): Elementos de econometría. 2ª ed. Ed. Vicens Vives

Pindyck R. y Rubinfeld D. (1980): Modelos econométricos. Ed. Labor.

Raymond, J.L. y Uriel, E. (1987): Investigación econométrica aplicada: un caso de estudio. Ed. AC.