

PROGRAMA DE CONOMETRÍA PRIMER SEMESTRE

Prof. J. L. Raymond

Curso 1999-2000

I) Introducción a la econometría

1) La naturaleza de la econometría

- 1.1) Concepto de econometría
- 1.2) Modelo económico y modelo econométrico

2) El modelo lineal de dos variables

- 2.1) Especificación lineal y estimador MCO
- 2.2) Coeficiente 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 MCO
- 3.3) Inferencia en el modelo de regresión

4) Otros tópicos del modelo de k variables

- 4.1) Estimación con restricciones
- 4.2) Cambio estructural
- 4.3) Variables ficticias
- 4.4) Corrección estacional
- 4.5) Multicolinealidad

Bibliografía

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

Kmenta, J. (1980), Elementos de econometría, Vicens Vives

Raymond, J. L. y Uriel, E. (1987), Investigación econométrica aplicada, Alfa-Centauro

PROGRAMA DE ECONOMETRÍA SEGUNDO SEMESTRE

Prof. J. L. Raymond

Curso 1999-2000

I) Algunos tópicos del modelo de regresión

Errores de especificación

Selección de modelos

II) Mínimos Cuadrados Generalizados

Definición del estimador

Autocorrelación

Heteroscedasticidad

III) Modelos dinámicos

Retardos de las variables exógenas

Retardos de la variable endógena

IV) Modelos simultáneos

Concepto

Identificación

Estimación

Bibliografía

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

Kmenta, J (1980), Elementos de econometría, Vicens Vives

Raymond, J. L. y Uriel, E, Investigación econométrica aplicada, Alfa-Centauro