

Programa de Introducción a la Econometría.
Prof.: M. Cabeza, C Piñol, C. Polo, J.Ll. Raymond
Curso 1995-1996

I Introducción a la econometría.

1. La naturaleza de la econometría.

- 1.1 Concepto de econometría.
- 1.2 Relaciones entre las variables económicas: identidades y relaciones de comportamiento.
- 1.3 Econometría teórica y econometría empírica.

2. El modelo lineal de dos variables.

- 2.1 La especificación lineal y el estimador M.C.O.
- 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.

Bibliografía

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

Gujarati, D.N. (1990): Econometría. 2ª edición. McGraw-Hill.

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.