

PROGRAMA DE INTRODUCCION A LA ECONOMETRIA. CURSO 1996-1997

Profesor: Clemente Polo

Despacho: B3-138. Horas de consulta: Lunes 15:30-17:30

Martes: 15:30-16:30

1. La Introducción a la Econometría pretende que el alumno conozca la teoría subyacente al modelo lineal de regresión y sea capaz de utilizar este modelo para analizar problemas económicos. La realización del curso exige un conocimiento de los conceptos básicos de Algebra Lineal y Estadística.

2. Habrá un único examen al final del semestre. El examen constará de unas preguntas tipo verdadero-falso, algunas preguntas teóricas y problemas. Los alumnos del plan viejo podrán realizar este examen que será contabilizado como un parcial.

3. El programa del semestre se subdivide en tres partes: Introducción, el modelo lineal de k variables y algunas extensiones. Otras extensiones más avanzadas se impartirán en el segundo semestre.

PARTE I. Introducción a la Econometría

1. La Econometría: concepto y papel

1.1 Definición

1.2 Hechos y modelos económicos

1.3 Especificación numérica de los modelos económicos

1.4 Clasificación de los modelos econométricos

1.5 Plan de trabajo del semestre

2. El modelo lineal de dos variables

2.1 La especificación lineal

2.2 El método de los momentos

- 2.3 El método de mínimos cuadrados
- 2.4 Coeficientes de correlación y determinación
- 2.5 Propiedades de los estimadores
- 2.6 Predicción

PARTE II. EL MODELO DE REGRESION LINEAL

- 3. El modelo lineal de k variables
 - 3.1 Revisión del modelo de dos variables
 - 3.2 El modelo de k variables
 - 3.3 Interpretación de los coeficientes de regresión
 - 3.4 Correlación simple, parcial y múltiple
 - 3.5 Análisis de la varianza y contraste de hipótesis
 - 3.6 Estimación con restricciones
- 4. Especificación del modelo y estabilidad de los regresores
 - 4.1 Variables omitidas y variables espúrias
 - 4.2 Estabilidad de los coeficientes

PARTE III. ALGUNAS EXTENSIONES DEL MODELO

- 5. Variables ficticias
 - 5.1 Variables ficticias: cambios en la intersección
 - 5.2 Variables ficticias: cambios en la pendiente
 - 5.3 Variables ficticias: cambios en los coeficientes
- 6. Multicolinearidad
 - 6.1 Ejemplos ilustrativos
 - 6.2 Algunas medidas de multicolinearidad
 - 6.3 Problemas para medir la multicolinearidad
 - 6.4 Soluciones al problema de la Multicolinearidad
 - 6.5 Análisis de componentes principales
 - 6.6 Eliminación de variables

6.7 Otras soluciones

Bibliografía recomendada

En castellano:

Johnston, J., 1987, *Métodos de Econometría* (3^a edición). Barcelona: Editorial Vicens Vives.

En inglés:

Gujarati, 1995, D.N., *Basic Econometrics* (3^a edición). McGraw-Hill. (Hay traducción en castellano de la 2^a edición.)

Maddala, G.S., 1988, *Introduction to Econometrics* (2^a edición). London: Macmillan Publishing Company.

Bibliografía adicional

En castellano:

Aznar, A. y A. García Ferrer (1990). *Problemas de Econometría* (3^a edición). Editorial Pirámide.

Kmenta, J. (1980), *Elementos de Econometría* (2^a edición). Barcelona: Editorial Vicens Vives.

Pyndick, R y D. Rubenfield (1980), *Modelos Económicos*. Barcelona: Editorial Labor.

Raymond, J.L. y E. Uriel (1987), *Investigación Econométrica Aplicada: un caso de estudio*. Madrid: Editorial AC.