

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 Econométricos*. Barcelona:
Editorial Labor.

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