

Denominación de la asignatura: ECONOMETRÍA I**Curso académico: 2008-09****Datos Generales**

Código	8983	Descripción
Crdts. Teor.	3,5	Modelo de regresión múltiple: validez de las estimaciones y su formulación dinámica. Modelo de ecuaciones simultáneas.
Crdts. Pract.	2,5	

Departamentos

FUNDAMENTOS DEL ANÁLISIS ECONÓMICO (100%)

Área

FUNDAMENTOS DEL ANALISIS ECONOMICO (415)

Estudios en los que se imparte

Licenciatura en Economía - plan 2001

Objetivos y Programa**Objetivos de la asignatura / competencias (2008-09)**

Presentar y estudiar los resultados básicos del modelo de regresión lineal clásico: supuestos, estimación (MCO Y MV), contrastes de hipótesis y predicción. Se analizan también algunas extensiones del Modelo Lineal General (MLG) tales como el uso de las variables binarias y el análisis de especificación (errores de especificación).

Contenidos teóricos y prácticos (2008-09)PROGRAMA DE "ECONOMETRÍA I"
(2008/2009)

1. Introducción

- 1.1. Objetivos y metodología de la Econometría.
- 1.2. Ejemplos de usos y aplicaciones.

2. Modelo Lineal General (MLG): Estimación MCO

- 2.1. Formulación del MLG: especificación del modelo e hipótesis básicas.
- 2.2. Estimación MCO: Definición y propiedades estadísticas
 - 2.2.1. Estimación MCO en el modelo de regresión simple
 - 2.2.2. Estimación MCO en el modelo de regresión múltiple
 - 2.2.3. Interpretación de los parámetros estimados, unidades de medida y forma funcional.
 - 2.2.4. Propiedades estadísticas del estimador MCO de β .
 - 2.2.5. Estimación de σ^2 y propiedades estadísticas del estimador
 - 2.2.6. Matriz de varianzas estimadas y errores estándar
- 2.3. Propiedades del ajuste MCO.

3. Modelo Lineal General (MLG) con errores normales.

- 3.1. Distribución de formas cuadráticas asociadas a la distribución normal.
- 3.2. Propiedades de los estimadores MCO con errores normales.
- 3.3. Estimadores de Máxima Verosimilitud (MV) del MLG con errores normales.
- 3.4. Eficiencia y cota de Cramer-Rao.

4. Contrastes de hipótesis en el MLG

- 4.1. Contrastes de restricciones lineales.
 - 4.1.1. Contrastes sobre un único coeficiente
 - 4.1.2. Contrastes de una restricción lineal
 - 4.1.3. Contrastes de un conjunto de restricciones lineales
- 4.2. Estimación con restricciones lineales.
- 4.3. Intervalos de confianza

5. Especificación y Predicción en el MLG

- 5.1. Variables binarias.
- 5.2. Contrastes de cambio estructural.
- 5.3. Errores de especificación; selección de variables.
- 5.4. Predicción; intervalo de predicción.

BIBLIOGRAFIA

(a) Bibliografía básica:

Fernández Gallastegui, A. Econometría. Prentice Hall. 2005

Greene, W. H. Análisis econométrico. Prentice Hall. 1998.

Wooldridge, J.M. Introducción a la Econometría -Un enfoque moderno-. Thomson Ed, 2006

(b) Bibliografía básica problemas:

Fernández, A. et al. Ejercicios de econometría. McGraw-Hill. (2 ed.) 2005

(c) Bibliografía complementaria:

Novalés, A. Econometría (2ª Ed.). McGraw-Hill. 1993.

Más información

Este documento tiene validez para la tramitación de convalidación, adaptación y reconocimiento de créditos cuando esté sellado por el Centro donde se cursó o por el Departamento responsable de su docencia.