

Denominación de la asignatura: ECONOMETRÍA II

Curso académico: 2008-09

Datos Generales

Código	8989	Descripción
Crds. Teor.	3,5	Modelo de regresión múltiple: validez de las estimaciones y su formulación dinámica. Modelo de ecuaciones simultáneas
Crds. 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)

En el curso de Econometría I se estudia la estimación e inferencia del modelo de regresión lineal bajo hipótesis ideales. En el curso de Econometría II se estudia la estimación e inferencia del modelo lineal cuando se relajan estas hipótesis. En primer lugar se estudian las propiedades asintóticas de los estimadores y se aborda el contraste de hipótesis en ausencia del supuesto de normalidad de los errores. A continuación se estudia la estimación e inferencia bajo heterocedasticidad o autocorrelación. Finalmente se aborda la estimación e inferencia con regresores endógenos.

Contenidos teóricos y prácticos (2008-09)

PROGRAMA DE ECONOMETRÍA II

Licenciatura en Economía
Licenciatura en Administración y Dirección de Empresas
Licenciatura en Derecho-ADE

Curso 2008/09

1. Resultados asintóticos en el Modelo Lineal General.
 - 1.1. Teoría asintótica.
 - 1.2. Propiedades asintóticas de los estimadores en el MLG
 - 1.3. Contrastes asintóticos en el MLG.
2. Heterocedasticidad.
 - 2.1. Introducción.
 - 2.2. Estimación MCO en presencia de heterocedasticidad.
 - 2.2.1 Propiedades estadísticas en muestras finitas
 - 2.2.2 Propiedades asintóticas
 - 2.2.3 Contraste de hipótesis
 - 2.3 Heterocedasticidad dependiente de variables conocidas
 - 2.3.1 Contrastes de heterocedasticidad
 - 2.3.2 Estimación MCG con Ω conocida
 - 2.3.3 Estimación MCG con Ω desconocida: MCGF
3. Series temporales
 - 3.1 Conceptos estadísticos básicos: proceso estocástico; estacionariedad
 - 3.2 Procesos autorregresivos AR(p)
 - 3.3 Procesos de media móvil MA(q)
 - 3.4 Procesos mixtos ARMA(p,q)
4. Autocorrelación
 - 4.1 Introducción
 - 4.2 Estimación MCO con autocorrelación
 - 4.3 Contrastes de autocorrelación
 - 4.4 Estimación MCG con autocorrelación
 - 4.4.1 Estimación con errores AR(1) y Ω conocida
 - 4.4.2 Estimación con errores AR(1) y Ω desconocida: MCGF
 - 4.4.3 Estimación con errores AR(p)
5. Regresores aleatorios y endogeneidad
 - 5.1 Regresores aleatorios

- 5.2 Endogeneidad
- 5.3 El estimador de variables instrumentales
 - 5.3.1 El modelo lineal simple
 - 5.3.2 El modelo lineal múltiple con una única variable endógena
 - 5.3.3 El modelo lineal múltiple con varias variables endógenas
 - 5.3.4 Propiedades asintóticas del estimador de variables instrumentales
- 5.4 Contraste de hipótesis con el estimador VI
- 5.5 Contraste de endogeneidad

BIBLIOGRAFIA

- a) Bibliografía básica:
 - Alonso, A., J. Fernández e I. Gallastegui. *Econometría*. Pearson Prentice Hall. 2005. (EC 330.4/ALO/ECO)
 - Greene, W. H. *Análisis econométrico*. Prentice Hall. 1998. (EC 330.4/GRE/ANA)
 - Wooldridge, Jeffrey M. *Introducción a la econometría*, Thomson 2006. (EC 330.4/WOO/INT)
- b) Bibliografía básica de problemas:
 - Fernández, A. et al. *Ejercicios de econometría*. McGraw-Hill. (2 ed.) 2005. (EC 330.4/EJE/EJE)
- c) Bibliografía complementaria:
 - Goldberger, Arthur S. *Introducción a la econometría*. Ariel. 2001. (EC 330.4/GOL/INT)
 - Novales, A. *Econometría*. McGraw-Hill. (2 ed.) 1994. (EC 330.4/NOV/ECO)
- d) Libros de problemas:
 - Aznar, A. et al. *Ejercicios de econometría*. Pirámide. 1994. (EC 330.4/AZN/EJE)

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.