



COLEGIO UNIVERSITARIO CARDENAL CISNEROS

ADSCRITO A LA UNIVERSIDAD COMPLUTENSE DE MADRID

**LICENCIATURA EN ADMINISTRACIÓN
Y DIRECCIÓN DE EMPRESAS**

CURSO 3º

**INTRODUCCION A LA ECOMETRIA
PROGRAMA**

CURSO 2009-2010

CÓDIGOS DE ASIGNATURA: 618

I. EL MODELO DE REGRESION LINEAL SIMPLE

1. INTRODUCCIÓN.

- ✓ Análisis de datos bidimensionales.
- ✓ Concepto de modelo. El modelo econométrico.
- ✓ Ejemplo 1: la función de consumo keynesiana.
- ✓ Etapas del trabajo econométrico.

2. PLANTEAMIENTO DEL MODELO.

- ✓ El modelo lineal simple: hipótesis básicas.
- ✓ Ejemplo 2: el modelo de educación de Mincer.
- ✓ Ejemplo 3: el modelo de mercado de Sharpe.

3. ESTIMACIÓN DEL MODELO.

- ✓ Estimación mínimo-cuadrática.
- ✓ Propiedades de los estimadores.
- ✓ Los residuos: relaciones más importantes.
- ✓ Descomposición de la varianza: el coeficiente de determinación.
- ✓ Estimación de la varianza de las perturbaciones.
- ✓ Hipótesis de normalidad. Estimación máximo-verosímil.

4. CONTRASTES DE HIPÓTESIS Y PREDICCIÓN.

- ✓ Intervalos de confianza para los parámetros.
- ✓ Contrastes de significación para cada parámetro.
- ✓ Contrastes "F".
- ✓ Predicción puntual. El error de predicción.
- ✓ Predicción por intervalo

5. PROBLEMAS EN LA ESTIMACIÓN DEL MODELO DE REGRESIÓN LINEAL SIMPLE.

- ✓ Problemas en la especificación del modelo.
- ✓ Heterocedasticidad: Concepto, consecuencias, detección y posibles soluciones.
- ✓ Autocorrelación: Concepto, consecuencias, detección y posibles soluciones.

II. TRATAMIENTO ESTADÍSTICO DE DATOS EN ECONOMIA

6. NÚMEROS ÍNDICES.

- ✓ Concepto y tipología.
- ✓ Los índices complejos. El problema de la ponderación.
- ✓ Propiedades de los números índices.
- ✓ Cambio de base. Enlace de números índices.
- ✓ Participación y repercusión de una modalidad en la variación del índice.
- ✓ Índices de precios e índices de cantidades. Propiedades y relaciones.
- ✓ El problema de la deflación.
- ✓ Ejemplos más importantes.

7. MEDIDAS DE CONCENTRACIÓN.

- ✓ Concepto.
- ✓ Índice de Gini.
- ✓ Curva de Lorenz.
- ✓ Otras medidas de concentración.

8. SERIES TEMPORALES.

- ✓ Concepto y componentes de una serie temporal.
- ✓ Estudio de la tendencia.
- ✓ Estudio de la estacionalidad. Métodos de desestacionalización.
- ✓ Tasas de variación en datos temporales.

BIBLIOGRAFÍA

Novalés, A.: "Estadística y Econometría" . Ed. McGraw-Hill. 1997

Martín Pliego, F.J.: "Introducción a la Estadística Económica y Empresarial. Teoría y práctica" (2ª edición). Ed. AC. 2000

Hill, R.C.; W.E. Griffiths y G.G.Judge: "Undergraduate Econometrics" (2ª edición). Ed. Wiley&Sons. 2001

Gujarati, D.N.: "Econometría" (4ª edición). Ed. McGraw-Hill. 2003

Peña, D.: "Regresión y Diseño de Experimentos". Alianza Universidad Textos. 2002