



**COLEGIO UNIVERSITARIO CARDENAL
CISNEROS**

ADSCRITO A LA UNIVERSIDAD COMPLUTENSE DE MADRID

**LICENCIATURA EN ADMINISTRACIÓN
Y DIRECCIÓN DE EMPRESAS**

CUARTO CURSO

**ECONOMETRÍA I
PROGRAMA Y BIBLIOGRAFÍA**

CURSO 2009-2010

CÓDIGOS DE ASIGNATURA: 642

1.- ESPECIFICACIÓN Y ESTIMACIÓN DEL MODELO LINEAL GENERAL.

- ✓ Hipótesis clásicas que conforman el Modelo Lineal General (MLG)
- ✓ Estimación MCO (Mínimos Cuadrados Ordinarios) de β .
- ✓ Propiedades estadísticas del estimador MCO de β .
- ✓ Propiedades algebraicas (numéricas) derivadas de la estimación MCO
- ✓ Estimación insesgada de la varianza de las perturbaciones
- ✓ Estimación MCO con datos en desviaciones con respecto a la media
- ✓ Regresión particionada y correlación parcial
- ✓ Distribuciones de los estimadores MCO bajo la hipótesis de Normalidad
- ✓ Estimación por Máxima Verosimilitud (MV) bajo la hipótesis de Normalidad

2.- CONTRASTES DE HIPÓTESIS Y PREVISIÓN.

- ✓ Introducción
- ✓ Contrastes de varias hipótesis lineales conjuntas sobre β .
- ✓ Contrastes de una única hipótesis lineal sobre β .
- ✓ Intervalos de confianza
- ✓ Estimación bajo restricciones lineales generales
- ✓ Previsión

3.- EXTENSIONES.

- ✓ Transformaciones lineales
- ✓ Multicolinealidad
- ✓ Errores de especificación
- ✓ Variables explicativas binarias (ficticias).