



**COLEGIO UNIVERSITARIO CARDENAL CISNEROS**

**ADSCRITO A LA UNIVERSIDAD COMPLUTENSE DE MADRID**

**LICENCIATURA EN ADMINISTRACIÓN  
Y DIRECCIÓN DE EMPRESAS**

**CURSO 4º**

**ECONOMETRIA II  
PROGRAMA**

**CURSO 2009-2010**

**CÓDIGOS DE ASIGNATURA: 643**

1. Análisis Univariante de Series Temporales
  - ✓ Introducción al Análisis Univariante de Series Temporales
  - ✓ Procesos Estocásticos Estacionarios
  - ✓ Modelos para Procesos Estacionarios
  - ✓ Modelos para Procesos No Estacionarios
  - ✓ Previsión con Modelos ARIMA
  - ✓ Modelos para Procesos Estacionales
  - ✓ El Enfoque Box-Jenkins para la Elaboración de Modelos ARIMA
  
2. Perturbaciones No Esféricas en el Modelo Lineal General
  - ✓ Introducción: Heteroscedasticidad y Autocorrelación
  - ✓ Consecuencias sobre los Estadísticos MCO
  - ✓ Estimación Robusta de la Matriz de Varianzas del Estimador MCO de  $b$
  - ✓ Mínimos Cuadrados Generalizados (MCG) con  $W$  Conocida
  - ✓ Heteroscedasticidad: Detección y Estimación con  $W$  Desconocida
  - ✓ Autocorrelación: Detección y Estimación con  $W$  Desconocida
  - ✓ Mínimos Cuadrados No Lineales (MCNL) y Máxima Verosimilitud (MV) con  $W$  Desconocida
  - ✓ Previsión con Perturbaciones No Esféricas
  
3. Regresores Estocásticos en el Modelo Lineal General
  - ✓ Introducción: Modelos con Regresores Estocásticos
  - ✓ Caso 1: Regresores Estrictamente Exógenos
  - ✓ Caso 2: Regresores Contemporáneamente Exógenos
  - ✓ Elementos de Teoría Asintótica
  - ✓ Propiedades Asintóticas de los Estadísticos MCO en los Casos 1 y 2
  - ✓ Caso 3: Regresores Endógenos
  - ✓ Estimación Consistente en el Caso 3: Variables Instrumentales (VI) y Mínimos Cuadrados en 2 Etapas (MC2E)

## **BIBLIOGRAFIA**

Manuales fundamentales:

- Box, G.E.P.; Jenkins, G.M.; Reinsel, G.C. (1994), [\*Time Series Analysis - Forecasting and Control\*](#) (Third Edition), Prentice Hall.
- Novales, A. (1993), *Econometría* (Segunda Edición), McGraw-Hill.
- Peña, D. (1989), *Estadística (Modelos y Métodos 2): Modelos Lineales y Series Temporales* (Segunda Edición), Alianza Editorial.
- Wooldridge, J.M. (2000), [\*Introductory Econometrics: A Modern Approach\*](#), South-Western College. (Existe una [segunda edición en inglés, 2002](#), y una traducción al castellano de la primera, 2001, editada por Paraninfo - Thomson Learning.)

Libros de problemas:

Aznar, A.; García-Ferrer, A.; Martín, A. (1994), *Ejercicios de Econometría I - II*, Pirámide.

Fernández, A.I.; González, P.; Regúlez, M.; Moral, M.P.; Esteban, M.V. (1995), *Ejercicios de Econometría*, McGraw-Hill.

Pérez, T.; Amorós, P.; Relloso, S. (1993), *Ejercicios de Econometría Empresarial*, McGraw-Hill.

Manuales sobre EViews (versión 3.1):

Carrascal, U.; González, Y.; Rodríguez, B. (2001), [Análisis Económico con EViews](#), Ra-Ma.

Reiman, M.A.; Hill, R.C. (2001), *Using EViews for Undergraduate Econometrics* (Second Edition), Wiley.