

# GUÍA DE ESTUDIO DEL ÁREA DE ECONOMETRÍA

## TEMAS

### 1) **MODELO DE REGRESIÓN LINEAL MÚLTIPLE**

- Formulación y supuestos básicos del modelo.
- Estimación por Mínimos Cuadrados Ordinarios
- Estimación por Máxima Verosimilitud
- Validación del modelo y medidas de bondad de ajuste
- Test de significación estadística individual y test de significación estadística conjunta
- Problemas relacionados con los datos
- Errores de Especificación
- Variables Cualitativas Explicativas

#### Bibliografía recomendada:

[1] Wooldridge, Jeffrey M. *Introducción a la Econometría: una Aproximación Moderna. 5ª Edición*, Michigan State University. 2012.

### 2) **MODELOS DE SERIES TEMPORALES**

- Modelos autorregresivos y de medias móviles. Modelos ARMA
- Variables no estacionarias.
- Modelos ARIMA
- Estacionalidad: modelos SARIMA
- Modelos de función de transferencia
- Regresión con variables no estacionarias
- Contrastes de raíz unitaria de Dickey y Fuller
- Cointegración
- Vectores autorregresivos (VAR)

#### Bibliografía recomendada:

[1] Gujarati D., Porter, D. *"Econometría"*, McGRAW-HILL- Interamericana Editores, S.A de C.V, S.A.U. 5ª Edición, 2010.

[2] Novalés, Alfonso. *Econometría. 2da Edición*. McGraw-Hill. Madrid. 1993.

### 3) **VARIABLES DEPENDIENTES CUALITATIVAS Y LIMITADAS**

- Modelos de elección discreta
- Variables dependientes limitadas

#### Bibliografía recomendada:

[1] Wooldridge, Jeffrey M. *Introducción a la Econometría: una Aproximación Moderna. 5ª Edición*, Michigan State University. 2012.