

GUÍA DE ESTUDIO DEL ÁREA DE ECONOMETRÍA

BIBLIOGRAFÍA RECOMENDADA

- [1] Wooldridge, Jeffrey M. *Introducción a la Econometría: una Aproximación Moderna*. 5ª Edición, Michigan State University. 2012.
- [2] Gujarati D., Porter, D. "Econometría", McGRAW-HILL- Interamericana Editores, S.A de C.V, S.A.U. 5ª Edición, 2010.
- [3] Novales, Alfonso. *Econometría*. 2da Edición. McGraw-Hill. Madrid. 1993.

TEMAS

1. MODELO DE REGRESIÓN LINEAL MÚLTIPLE

- 1.1 Formulación y supuestos básicos del modelo. *Wooldridge, 2012. Cap. 3 y 4.*
- 1.2 Estimación por Mínimos Cuadrados Ordinarios. *Wooldridge, 2012. Cap. 3*
- 1.3 Estimación por Máxima Verosimilitud. *Wooldridge, 2012. Cap. 3*
- 1.4 Validación del modelo y medidas de bondad de ajuste. *Wooldridge, 2012. Cap. 4*
- 1.5 Test de significación estadística individual y test de significación estadística conjunta. *Wooldridge, 2012. Cap. 4.*
- 1.6 Problemas relacionados con los datos. *Gujarati D., 2010. Cap. 7 y 8*
- 1.7 Errores de Especificación. *Wooldridge, Cap. 8 y 9*
- 1.8 Variables Cualitativas Explicativas. *Wooldrige. Cap. 7*

2. MODELOS DE SERIES TEMPORALES

- 2.1 Modelos autorregresivos y de medias móviles. Modelos ARIMA. *Novales A., 1993. Cap. 13 y 14.*
- 2.2 Variables no estacionarias. *Novales A., 1993. Cap. 13 y 14.*
- 2.4 Estacionalidad: modelos SARIMA. *Novales A., 1993. Cap. 13 y 14.*
- 2.5 Modelos de función de transferencia. *Novales A., 1993. Cap. 13 y 14.*
- 2.6 Regresión con variables no estacionarias. *Novales A., 1993. Cap. 13 y 14. Gujarati D., 2010. Cap. 21*
- 2.7 Contrastes de raíz unitaria de Dickey y Fuller. *Novales A., 1993. Cap. 13 y 14. Gujarati D., 2010. Cap. 21 y 22. Gujarati D., 2010. Cap. 21*
- 2.9 Vectores autorregresivos (VAR). *Gujarati D., Cap. 22*
- 2.8 Cointegración. *Novales A., 1993. Cap. 13 y 14. Gujarati D., Cap. 22*

3. VARIABLES DEPENDIENTES CUALITATIVAS Y LIMITADAS

3.1 Modelos con variables dependientes limitadas. *Wooldridge, 2012. Cap. 17.*