

09.04.00

# INDICE

52357

Prefacio .....	9
I. ¿Qué es la econometría? .....	11
II. Introducción a los modelos econométricos .....	13
2.1. Un sistema sencillo de renta nacional, 13.—2.2. Un ejemplo de demanda y oferta, 18.—2.3 Modelos estocásticos, 21.—2.4. Representaciones generales de modelos de ecuaciones simultáneas, 26.—Ejercicios, 31.	
III. Modelos dinámicos .....	33
3.1. Introducción, 33.—3.2. Retardos distribuidos, 35.—3.3. La hipótesis del ajuste parcial, 40.—3.4. Modelos de expectativas, 43.—3.5. Sistemas dinámicos, 49.—3.6. Otros ejemplos de modelos dinámicos, 53.—3.7. Modelos dinámicos estocásticos, 58.—3.8. La hipótesis de las expectativas racionales, 60.—Ejercicios, 65.	
VI. El problema de la identificación .....	67
4.1. Introducción, 67.—4.2. Una ilustración de la oferta y la demanda, 69.—4.3. Condiciones de orden y de rango, 75.—4.4. Una condición de orden equivalente y su forma reducida, 81.—4.5. Identificación mediante restricciones lineales homogéneas sobre los parámetros, 84.—Ejercicios, 88.	
V. El modelo de regresión simple de dos variables .....	89
5.1. Estimación de una ecuación de la forma reducida, 89.—5.2. Propiedades de las estimaciones por mínimos cuadrados, 95.—5.3. Contraste de la significatividad de los coeficientes, 101.—5.4. Bondad del ajuste, 104.—5.5. Predicción, 106.—5.6. Una ilustración empírica, 109.—5.7. Estimación por máxima verosimilitud, 111.—5.8. Errores en las variables, 113.—Ejercicios, 116.	
VI. Análisis de regresión múltiple .....	119
6.1. Estimación de una ecuación de la forma reducida, 119.—6.2. Propiedades y contrastes de significatividad, 121.—6.3. Multicolinealidad, 125.—6.4. Predicción, 127.—6.5 Regresión particionada, 129.—6.6. Consecuencias de no especificar bien una ecuación, 132.—Ejercicios, 137.	
VII. Algunas aplicaciones del modelo de regresión .....	139
7.1. Variables ficticias, 139.—7.2. Forma funcional, 150.—7.3. Restricciones lineales, 154.—7.4. Contraste del cambio estructural, 160.—7.5. Funciones «quebradas», 162.—7.6. Modelos de retardos distribuidos, 164.—Ejercicios, 170.	

Compra

VIII. Autocorrelación .....	173
8.1. Causas de la autocorrelación, 173.—8.2. Consecuencias de los OLS, 174.—8.3. Representaciones de la autocorrelación, 174.—8.4. Contraste de la autocorrelación, 180.—8.5. Estimación en presencia de autocorrelación, 186.—8.6. Predicción en presencia de autocorrelación, 192.—8.7. Implicaciones de la autocorrelación para la especificación dinámica, 194.—Ejercicios, 195.	
IX. Heterocedasticidad .....	197
9.1. Causas de la heterocedasticidad, 197.—9.2. Consecuencias para los OLS, 198.—9.3. Representaciones de la heterocedasticidad, 198.—9.4. Contrastes de la heterocedasticidad, 199.—9.5. Estimación con heterocedasticidad, 201.—9.6. Interpretación de la heterocedasticidad, 205.—Ejercicios, 206.	
X. La estimación de ecuaciones estructurales .....	209
10.1. Mínimos ordinarios y sesgo de ecuaciones simultáneas, 209.—10.2. Sistemas recursivos, 214.—10.3. Mínimos cuadrados indirectos, 216.—10.4. El método de las Variables Instrumentales, 220.—10.5. Estimación de una ecuación sobreidentificada: mínimos cuadrados bietápicos, 226.—10.6. Estimación en presencia de autocorrelación, 235.—Ejercicios, 238.	
Problemas de repaso .....	241
Soluciones abreviadas de los ejercicios pares .....	247
Tabla: Indicador Durbin-Watson .....	264
Índice analítico .....	265