



UNIVERSIDAD NACIONAL AUTÓNOMA  
DE MÉXICO



FACULTAD DE ECONOMÍA

---

## INTRODUCCIÓN A LA ECONOMETRÍA

**BENJAMIN LÓPEZ ORTÍZ**

[Benjamín.lopez@uab.cat](mailto:Benjamín.lopez@uab.cat)

CURSO 2011-I - EB

**OBJETIVO:** El curso tiene por objetivo proporcionar una base sólida para la comprensión y la aplicación de técnicas cuantitativas en la investigación económica así como familiarizar al alumno, de modo riguroso, con los principios básicos de la teoría econométrica.

### TEMARIO

#### UNIDAD 1. Qué es la econometría

#### UNIDAD 2. Principios de la construcción econométrica

- 2.1. Definición de modelo
- 2.2. La construcción de modelos
- 2.3. Elementos constitutivos de los modelos

#### UNIDAD 3. El problema de la identificación

- 3.1. Introducción
- 3.2. Condiciones de orden y rango
- 3.3. Identificación mediante restricciones lineales

#### UNIDAD 4. El modelo de regresión lineal simple

- 4.1. Estimación de una ecuación de la forma reducida
- 4.2. Propiedades de las estimaciones por mínimos cuadrados
- 4.3. El modelo de regresión
- 4.4. El modelo de correlación
- 4.5. Autocorrelación
- 4.6. Contraste de la significatividad de los coeficientes
- 4.7. Predicción

#### UNIDAD 5. El modelo de regresión lineal múltiple

- 5.1. Modelos económicos de análisis de regresión múltiple
- 5.2. El modelo de regresión múltiple
- 5.3. Fluctuaciones de los coeficientes de correlación y regresión
- 5.4. Multicolinealidad
- 5.5. Predicción
- 5.6. Principales problemas

#### **UNIDAD 6. Introducción a las series de tiempo**

- 6.1. Números índice y series cronológicas
- 6.2. Componentes y modelos de series de tiempo
- 6.3. Tendencia secular
- 6.4. Variaciones estacionales
- 6.5. Variaciones cíclicas e irregulares
- 6.6. Predicción

#### **BIBLIOGRAFÍA BÁSICA**

1. Dagon, Camilo y Estela M. Bee de Dagon; **Introducción a la Econometría**; Edit. Siglo XXI; México; 1971
2. Karl, Fox; **Manual de Econometría**; Edit. Amorrortu; Argentina; 1973
3. Pindyck, Robert y Rubinfeld Daniel; **Econometría y Pronósticos**, 4ª Edición, Edit. McGraw Hill, 2001
4. Wooldridge, Jeffrey, **Introducción a la Econometría: Un Enfoque Moderno**, Edit. Thomson, 2001
5. Mark, B. Stewart y Kenneth, F. Wallis; **Introducción a la Econometría**; Edit. Alianza Editorial; España; 1984
6. Mendenhall, W.; **Estadística para Administradores**; Edit. Grupo Editorial Iberoamericana; México; 1990
7. Miller, T.; **Economic Statistics and Econometrics**; 2ª Edición; Edit. Maxwell McMillan International; 1990
8. Wonnacott, T.; **Fundamentos de Estadística para Administración y Economía**; Edit. Limusa; México; 1989

#### **BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA**

1. Chiang, A.C., Fundamental Methods of Mathematical Economics, McGraw-Hill, Inc, 1987.

#### **EVALUACIÓN**

70% Examen final y 30% ejercicios, asistencia y participación.