

JOSE HERNANDEZ ALONSO

EJERCICIOS DE ECONOMETRIA



Madrid, 1992

INDICE

PROLOGO	5
PRESENTACION	6
NOTA A LA SEGUNDA EDICION	11
1. MODELOS ECONOMETRICOS	17
Concepto	17
Especificación	18
Clasificación	20
Ejercicios	21
2. MODELO LINEAL SIMPLE	33
Presentación del modelo	33
Estimación mínimo-cuadrática de los parámetros	34
Modelo descriptivo y su representatividad	36
Fiabilidad de las estimaciones de los parámetros	37
Contrastes de hipótesis sobre los parámetros	39
Predicción. Valor medio y valor individual	40
Modelos no lineales. Linealización	42
Estimación con datos centrados	42
Esquema resumen de realización de cálculos y presentación de resultados	44

Ejercicios	47
3. MODELO LINEAL GENERAL	95
Presentación del modelo	95
Estimadores mínimo-cuadráticos de los parámetros	96
Varianza residual y coeficiente de determinación múltiple	97
Fiabilidad de las estimaciones de los parámetros	98
Contrastes de hipótesis sobre los parámetros	99
Predicción. Valor medio y valor individual	102
Cálculo con datos centrados	103
Esquema resumen de realización de cálculos y presentación de resultados	105
Ejercicios	105
4. EXTENSIONES AL MODELO UNIECUACIONAL	147
Transformaciones lineales en el modelo	147
Mínimos cuadrados restringidos	149
Variables ficticias	151
Estimación de modelos no lineales	155
Ejercicios	156
5. CONTRASTES DE HIPOTESIS BASICAS	191
Introducción	191
Autocorrelación	192
Heteroscedasticidad	196
No normalidad	196

Multicolinealidad	197
Cambio estructural	198
Ejercicios	201
6. ELABORACION Y VALIDACION DE MODELOS UNIECUACIONALES	247
Introducción	247
Estrategias investigadoras	248
Tipos de contrastes de validez de la ecuación	249
Validación del modelo	251
Ejemplo de selección entre especificaciones alternativas	252
7. LOS DATOS ESTADISTICOS	269
Introducción	269
Regresión y causalidad	270
Datos y uso de ordenador	271
Observaciones influyentes y robustez de los datos	271
Ejercicios	273
APENDICE A. Repaso de conceptos estadísticos	297
APENDICE B. Rudimentos de algebra matricial	309
APENDICE C. Tablas estadísticas	323
BIBLIOGRAFIA	331