
métodos de econometría

J. Johnston

Universidad de California, Irvine.

Traducido por:

JESÚS SÁNCHEZ FERNÁNDEZ

Profesor Titular de Estadística, de la Universidad de Málaga.

Presentación a la edición española:

A. GARCÍA BARBANCHO

Catedrático de Econometría, de la Universidad de Sevilla.



editorial vicens-vives®

<i>Prefacio</i>	VII
1. <i>La naturaleza de la econometría</i>	1
1-1 Elaboración de modelos económicos	1
1-2 Un modelo de renta nacional	2
1-3 Cuestiones no resueltas	4
1-4 El papel de la econometría	6
1-5 Forma estructural y forma reducida	7
1-6 Multiplicadores y propiedades dinámicas	9
2. <i>El modelo lineal de dos variables</i>	15
2-1 La especificación lineal	15
2-2 Estimadores mínimo-cuadráticos	20
2-3 El coeficiente de correlación	28
2-4 Propiedades de los estimadores mínimo-cuadráticos	30
2-5 Inferencia en el modelo mínimo-cuadrático	40
2-6 Análisis de la variancia en la regresión por mínimos cuadrados	46
2-7 Predicción con el modelo mínimo-cuadrático	50
3. <i>Ampliaciones del modelo lineal de dos variables</i>	57
3-1 Observaciones repetidas y un «test» de linealidad	57
3-2 Relaciones no lineales	71
3-3 Transformaciones de variables	73
3-4 Regresión con tres variables	87
4. <i>Elementos de álgebra matricial</i>	105
4-1 Operaciones con vectores y matrices	108
4-2 Formulación matricial del problema de los mínimos cuadrados	118
4-3 Interpretación geométrica de los mínimos cuadrados	123
4-4 Resolución de sistemas de ecuaciones	134

4-5	El problema de los valores característicos	167
4-6	Formas cuadráticas y matrices definidas positivas	179
4-7	Valores máximos y mínimos	183
5.	<i>El modelo lineal de K variables</i>	193
5-1	Resultados estadísticos preliminares	193
5-2	Hipótesis del modelo lineal	201
5-3	Estimadores mínimo-cuadráticos ordinarios (MCO)	205
5-4	Inferencia en el modelo MCO	217
6.	<i>Otros tópicos del modelo lineal de K variables</i>	245
6-1	Estimación con restricciones lineales	245
6-2	«Test» de cambio estructural	248
6-3	Variables ficticias	271
6-4	Corrección estacional	280
6-5	Multicolinealidad	287
6-6	Error de especificación	312
7.	<i>Estimadores máximo-verosímiles y distribuciones asintóticas</i>	321
7-1	Resumen e introducción	321
7-2	Algunas puntualizaciones sobre la teoría asintótica	322
7-3	Estimadores máximo-verosímiles	329
7-4	Algunos resultados asintóticos para el modelo lineal de K variables	336
8.	<i>Mínimos cuadrados generalizados</i>	345
8-1	Causas de las perturbaciones no esféricas	345
8-2	Propiedades de los estimadores MCO con perturbaciones no esféricas	349
8-3	El estimador por mínimos cuadrados generalizados	350
8-4	Heteroscedasticidad	353
8-5	Autocorrelación	366
8-6	Sistemas de ecuaciones	399
9.	<i>VARIABLES RETARDADAS</i>	415
9-1	Origen de las variables retardadas	415
9-2	Métodos de estimación	426
9-3	Métodos de series temporales	450
10.	<i>Otros temas variados</i>	467
10-1	Residuos recursivos	467
10-2	Funciones quebradas	477

10-3	Combinación de series temporales y datos transversales	482
10-4	Modelos con parámetros cambiantes	495
10-5	VARIABLES dependientes cualitativas	511
10-6	Errores en las variables	521
11.	<i>Sistemas de ecuaciones simultáneas</i>	535
11-1	Algunos sistemas ilustrativos de ecuaciones simultáneas	535
11-2	El problema de la identificación	548
11-3	Estimaciones de modelos de ecuaciones simultáneas	569
12.	<i>Econometría en la práctica: problemas y perspectivas</i>	607
<i>Apéndice A. Apéndices matemático y estadístico</i>		631
A-1	Funciones y derivadas	631
A-2	Funciones exponencial y logarítmica	632
A-3	Operaciones con signos sumatorios	636
A-4	VARIABLES aleatorias y distribución de probabilidad	639
A-5	Distribución de probabilidad normal	642
A-6	Multiplicadores de Lagrange y optimización restringida	644
A-7	Relaciones entre las distribuciones normal, X^2 , t y F	646
A-8	Esperanzas en variaciones bivariantes	647
A-9	Cambio de variables en funciones de densidad	653
A-10	Componentes principales	653
<i>Apéndice B. Tablas estadísticas</i>		665
B-1	Áreas de una distribución normal tipificada	667
B-2	Distribución t de Student	668
B-3	Distribución χ^2	669
B-4	Distribución F	670
B-5	Estadístico de Durbin-Watson (Tablas de Savint-White)	674
B-6	Estadístico de Wallis para la autocorrelación de cuarto orden	678
B-7	Razón de Von Neumann modificada	679
B-8	Valores de significación para c_0 del «test» de suma acumulada de cuadrados	680
<i>Índice de materias</i>		681