

UNIVERSIDAD NACIONAL AUTÓNOMA DE MÉXICO
FACULTAD DE ECONOMÍA
Semestre 2017-II
Guía para Exámen Extraordinario – Introducción a la Econometría
Mtro. Luis Sánchez

1. Método de mínimos cuadrados (MCO)
2. Estimación por máxima verosimilitud
3. Supuestos del modelo de regresión lineal clásico
4. Propiedades de insesgamiento, eficiencia y consistencia en los estimadores de MCO
5. Inferencia estadística: Pruebas t, F y Chi-cuadrada
6. Bondad de ajuste
7. Restricción de parámetros
8. Errores de especificación: Multicolinealidad, No normalidad, Autocorrelación, Heteroscedasticidad y Cambio Estructural y prueba de diagnóstico (Jarque-Bera, LM, White, ARCH, CUSUM y CUSUMQ)
9. Modelos de elección cuantitativa
10. Análisis univariado: proceso estacionarios y no estacionarios, proceso autorregresivo (AR), procesos promedio móvil (MA) y proceso autorregresivo con promedio móvil integrados (ARIMA)

Bibliografía:

- Maddala, G. (1989). *Introducción a la Econometría*. McGraw-Hill
- Gujarati, D. y D. Porter (2010). *Econometría*. McGraw-Hill
- Johnston, J. y J. Dinardo (2001). *Métodos de Econometría*. Vicens Vives
- Greene, W. (1991). *Análisis Económico*. Prentice Hall
- Pindick R. y D. Rubinfeld (2000). *Econometría: Modelos y Pronósticos*. McGraw-Hill
- Wooldridge, J. (2010). *Introducción a la Econometría: Un enfoque moderno*. Thomson Learning
- Cuthbertson, K., S. Hall y M. Taylor (1992). *Applied Econometric Techniques*. Philip Allan