UNIVERSIDAD DE GRANADA

Departamento Métodos Cuantitativos para la Economía y la Empresa

Enero. Seminarios Métodos Cuantitativos para la Economía y la Empresa 2011-2016

25/01/2016

El Departamento de Métodos Cuantitativos para la Economía y la Empresa tiene el placer de invitarles a las siguientes charlas organizadas en el marco de los Seminarios Métodos Cuantitativos para la Economía y la Empresa 2015-2016 y el Máster en Técnicas Cuantitativas en Gestión Empresarial

Título

Técnicas cuantitativas para el tratamiento de la multicolinealidad en modelos econométricos

Ponente

Román Salmerón

Dpto de Métodos Cuantitativos para la Economía y la Empresa Universidad de Granada

Fecha

Jueves, 28 de enero de 2016, 10:00 horas, Aula E05 de la Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales.

Resumen

La regresión lineal múltiple es una herramienta estadística ampliamente usada para analizar cómo influyen (si es que lo hacen) un conjunto de variables (exógenas) en otra (endógena), permitiendo la estimación numérica de los signos y magnitudes de los coeficientes en una relación lineal previamente establecida. Una de las características de las variables económicas es la posible correlación entre ellas

Copyright© 2025 Universidad de Granada

debido a la existencia de determinantes comunes, por lo que la colinealidad entre variables explicativas en una regresión múltiple debe considerase una situación habitual. En tal situación, el estimador de mínimos cuadrados pierde eficiencia, por lo que los contrastes paramétricos sobre los coeficientes pierden potencia. Frente a alternativas como la obtención de más datos, la utilización del estimador cresta o incluso más drásticas, como la exclusión del modelo de alguna variable explicativa, proponemos el uso del modelo de regresión ortogonal, del estimador alzado o de la detección de observaciones que puedan ser causantes de la multicolinealidad.

Ficheros Adjuntos

- SeminariosMCEE2016_Enero.pdf

Copyright© 2025 Universidad de Granada