



Jueves 28 de Enero de 2016, 10:00

Aula E05 - FCCEE

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.

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 debido a la existencia de determinantes comunes, por lo que la colinealidad entre variables explicativas en una regresión múltiple debe considerarse 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.