

“PRUEBAS DE ESPECIFICACIÓN ECONOMÉTRICA”

En este trabajo se deberá explicar las metodologías de pruebas formales para validar la correcta especificación de un modelo econométrico respondiendo a la pregunta: ¿en qué consiste cada prueba de especificación (se preguntará en el primer parcial)? (Es contenido básico de econometría I).

1. Normalidad de Residuos
 - ✓ Prueba de Jarque-Bera.
2. No correlación serial
 - ✓ Prueba de Breusch-Godfrey multiplicador de Lagrange (LM).
 - ✓ Prueba Durbin-Watson.
3. No heteroscedasticidad
 - ✓ Prueba de efecto ARCH.
 - ✓ Prueba de Harvey.
 - ✓ Prueba de Glejser.
 - ✓ Prueba de White.
4. No multicolinealidad
 - ✓ Altas correlaciones parciales.
 - ✓ Factores de inflación de varianza.
5. Estabilidad de parámetros
 - ✓ Test de Cusum.
 - ✓ Test de Cusm de cuadrados.
 - ✓ Parámetros recursivos.
6. Especificación del modelo
 - ✓ Prueba de variables omitidas (razón de verosimilitud, *likelihood ratio*).
 - ✓ Prueba de variables redundantes (razón de verosimilitud, *likelihood ratio*).
 - ✓ Prueba de Ramsey-Reset.

