

Índice

Introducción	VII
---------------------------	------------

Capítulo 1. Predicción económica y empresarial. Modelos para predicciones incondicionales deterministas.....	I
---	----------

Predicciones y su tipología	I
Suavizado lineal de Holt	2
Suavizado exponencial de Brown.....	2
Suavizado estacional de Winters.....	3
Suavizado por medias móviles	3
Excel y los modelos de predicción incondicional determinista.....	4
Medias móviles mediante líneas de tendencia.....	4
Medias móviles mediante herramientas de análisis.....	6

Capítulo 2. Predicción económica y empresarial. Modelos para predicciones incondicionales estocásticas.....	31
--	-----------

Predicciones incondicionales estocásticas.....	31
Descomposición clásica de una serie temporal.....	31
Análisis de la tendencia de una serie temporal. Métodos del ajuste analítico, medias móviles y diferencias	32
Método del ajuste analítico	33
Variaciones estacionales. Desestacionalización	36
Método de desestacionalización de la tendencia o método de las relaciones de medias mensuales respecto a la tendencia	36
Métodos de desestacionalización del índice estacional.....	37
Método de desestacionalización de las medias móviles.....	38
Método de desestacionalización de las diferencias estacionales.....	38
Excel y el análisis de la tendencia.....	38
Suavizado exponencial en Excel con herramientas de análisis	41

Capítulo 3. Predicción económica y empresarial. Modelos para predicciones condicionales..... 65

Predicciones condicionales..... 65
 Modelos econométricos con datos de series temporales 65
 Modelo de regresión múltiple con datos de series temporales..... 66
 Estimación del modelo por mínimos cuadrados ordinarios (MCO)..... 68
 Inferencia en el modelo por mínimos cuadrados ordinarios (MCO) 69
 Predicciones condicionales en modelos de series temporales..... 73
 Análisis de los residuos 74
 Funciones de Excel para estimación y predicciones condicionales 76
 Estimación y predicciones condicionales mediante herramientas de análisis 82

Capítulo 4. Modelos probabilísticos discretos y continuos. Modelos de fiabilidad.... 107

Modelos probabilísticos discretos 107
 Distribuciones discretas de una y dos dimensiones. Características 109
 Modelos binomial, de Poisson, geométrico e hipergeométrico..... 111
 Modelo multinomial 113
 Modelo hipergeométrico generalizado 114
 Modelo uniforme discreto..... 115
 Regla de Laplace y teorema de Bayes 115
 Excel y los modelos probabilísticos discretos..... 117
 Modelos probabilísticos continuos 119
 Distribuciones continuas de una y dos dimensiones. Características 121
 Modelos continuos relevantes: normal, exponencial, T, F, etc. 123
 Excel y los modelos probabilísticos continuos..... 127
 Modelos de fiabilidad 129
 Excel y los modelos de fiabilidad..... 132

Capítulo 5. Modelos de relación y asociación para variables cuantitativas y cualitativas 153

Modelos bidimensionales de frecuencias..... 153
 Modelos con variables cuantitativas: Tablas de correlación y covarianza..... 153
 Independencia y correlación entre variables cuantitativas. Modelos de regresión..... 157
 Coeficiente de correlación lineal y modelo de regresión simple mínimo cuadrática 157
 Modelo de regresión parabólica..... 160
 Modelo de regresión polinómica 160
 Modelos de regresión hiperbólica, potencial y exponencial 161
 Distribuciones cuantitativas con más de dos dimensiones. Matriz de covarianzas y matriz de correlaciones 161

Modelos con variables cualitativas: Tablas de contingencia, independencia y coeficientes de asociación y relación.....	162
Independencia y asociación de variables cualitativas. Coeficientes	164
Coeficiente de correlación por rangos.....	168
Funciones de Excel para la relación entre variables cuantitativas	168
Herramientas de análisis de Excel para la relación entre variables cuantitativas	171
Correlación y matriz de correlaciones.....	171
Covarianza y matriz de covarianzas	173
Funciones de Excel para la relación entre variables cualitativas	174
Tabla de contingencia para variables cualitativas.....	175
Contrastes de independencia y medidas de asociación.....	177
Capítulo 6. Modelos del análisis de la varianza y la covarianza	199
Introducción a los modelos del análisis de la varianza y la covarianza	199
Modelo ANOVA con un solo factor. Efectos fijos y aleatorios.....	201
Modelo ANOVA con dos factores. Efectos fijos, aleatorios y mixtos.....	206
Modelo en bloques aleatorizados	212
Modelo ANOVA con tres factores.....	212
Modelo en cuadrado latino.....	213
Modelos ANCOVA de la covarianza simple	214
Modelo con un factor y un covariante.....	214
Modelo con dos factores y un covariante.....	215
Modelo con dos factores y dos covariantes.....	215
Excel y los modelos del análisis de la varianza.....	215
Análisis de la varianza unifactorial.....	216
Análisis de la varianza de dos factores con una muestra por grupo.....	218
Análisis de la varianza de dos factores con varias muestras por grupo	219
Índice alfabético.....	229