

UNIVERSIDAD DE LOS ANDES
Facultad de Economía

PROGRAMA DE ECONOMETRIA AVANZADA

Prof.: Alberto Melo
Primer semestre 1988

OBJETIVO

El curso se propone presentar una panorámica del estado del arte en econometría que sea adecuada a las necesidades de estudiantes de postgrado.

METODOLOGIA

Aparte de las exposiciones del profesor, los estudiantes elaborarán un trabajo cuyo propósito será modelar un sector específico de la economía colombiana.

EVALUACION

- 2 exámenes parciales	20% c/u
- tareas, ejercicios y comprobaciones de lectura	20%
- trabajo empírico	20%
- examen final	20%

CONTENIDOS

1. El Modelo Lineal General (repaso)
2. El estimador de Aitken (repaso)
3. Conjunto de ecuaciones de regresión relacionadas a través del término de error
4. Modelos de Ecuaciones Lineales simultáneas
 - 4.1 Especificación del modelo
 - 4.2 El problema de la identificación
 - 4.3 Métodos de estimación
5. Modelos de rezagos distribuidos
6. Análisis de series de tiempo. Modelos ARIMA.
7. Modelos autorregresivos vectoriales

BIBLIOGRAFIA

La referencia básica para la mayoría de los temas es: Judge, Hill, Griffiths, Lutkepohl y Lee, Introduction to the Theory and Practice of Econometrics, John Wiley & Sons., Otras referencias bibliográficas serán dadas en clase a medida que se desarrollan los temas.