



UNIVERSIDAD DE LOS ANDES
FACULTAD DE ECONOMIA
Cra 1E No. 18A-10 Bloque C Oficina 309
A.A. 4976
PBX: 3394949, 3394999, Ext.2435, 2420
FAX: 3324492
E-MAIL: rosales@uniandes.edu.co
Bogotá -- Colombia

UNIVERSIDAD DE LOS ANDES
FACULTAD DE ECONOMIA
PEMAR
ECONOMETRIA AVANZADA

Profesor: Ramón Rosales; rosales@uniandes.edu.co
Profesor Taller: Alexander Bonilla; jbonilla@dnp.gov.co
Monitor: Ramon's Claude Jean-Philippe; r-jean-p@uniandes.edu.co

PROGRAMA

I. OBJETIVO

El curso tiene como objetivo principal el de presentar el marco teórico y operativo de las técnicas econométricas utilizadas en el análisis económico de los problemas relacionados con la economía del medio ambiente y de los recursos naturales.

II. METODOLOGIA

El profesor hará en las clases la presentación del marco teórico y operativo de las técnicas econométricas. Se presentarán ejercicios en clase con el fin de facilitar la comprensión y discusión de los temas. Se dejarán talleres para cada tema que les permitan a los estudiantes revisar los conceptos vistos en clase y ganar agilidad en el manejo operativo. Se establecerán lecturas requeridas para cada tema tanto teóricas como aplicadas. Al final de cada tema un grupo de estudiantes presentará uno o dos artículos aplicados, con el propósito de discutir la utilidad de los conceptos desarrollados en dicho tema.

El profesor del taller llevará a cabo una sección de dos horas semanales con el fin de desarrollar el marco operativo de los ejercicios en clase, repasar conceptos y ayudar a solucionar las dudas que se tengan de los talleres. Limdep y Eviews son los programas con los cuales se trabajarán (opcionalmente los estudiantes podrán utilizar otros programas como SAS, SPSS, etc). Los talleres deberán tener como anexos los listados (ó salidas) utilizados para la solución.

III. EVALUACIONES

Parcial 1	20%
Parcial 2	20%
Examen final	20%
Talleres	20%
Presentaciones	10%
Quices	10%

IV. CONTENIDO DEL CURSO

1. REVISIÓN Y APLICACIONES DEL MODELO LINEAL GENERAL

Revisión del modelo lineal general: especificación, estimación, pruebas de hipótesis y predicción
Aplicaciones a estimaciones de funciones de demanda, oferta, producción y costos
Supuestos del modelo de regresión clásico y mínimos cuadrados generalizados
Estimadores de máxima verosimilitud y pruebas de hipótesis asintóticas
Series de Tiempo

2. MODELOS ECONOMETRICOS DINAMICOS

El modelo de koyck
El modelo de expectativas adaptativas
El modelo de ajuste parcial
El modelo de almon

3. MODELOS DE ECUACIONES SIMULTANEAS

El problema de la identificación y métodos de estimación
Mínimos cuadrados indirectos
Mínimos cuadrados en dos etapas
Mínimos cuadrados en tres etapas
Sur

4. METODOS DE ESTIMACION NO LINEAL

Modelos de regresión no lineales
Los métodos gauss-newton y newton-raphson
Estimador de máxima verosimilitud
Transformación box-cox

5. VARIABLES CUALITATIVAS

Modelos Dicótomos
Modelo de Datos Agrupados
Modelos Policótomos
Estimación de Modelos Poisson
Modelos Truncados y Modelos Censurados
Econometría de los métodos de valoración económica de bienes no mercadeables: valoración contingente, precios hedónicos, costos de viaje, función de daño, función dosis-respuesta

6. DATOS DE PANEL

Modelos de Efectos Fijos
Modelos de Efectos Aleatorios

V. BIBLIOGRAFIA

Greene, W.H. 2000. Econometric Analysis. Fourth Edition. Prentice Hall.
Judge, G.G., Hill, R.C., Griffiths, W.E., Lutkepohl, H. And Lee, T. 1988. Introduction to the Theory and Practice of Econometrics. Second Edition. John Wiley and Sons.