

UNIVERSIDAD DE LOS ANDES
 FACULTAD DE ECONOMIA
 PROGRAMA DE ECONOMETRIA

Segundo Semestre de 1989
 Prof.: Dr. Alberto Melo Giraldo

I. OBJETIVOS

El curso se propone dos objetivos:

- i) Proporcionar a los estudiantes los elementos teóricos fundamentales de la econometría.
- ii) Brindar a los estudiantes la posibilidad de desarrollar una primera experiencia práctica, relativamente intensiva, con las técnicas econométricas relacionadas con el modelo de regresión lineal.

II. CONTENIDOS

- 1. El Modelo Lineal General y el estimador de mínimos cuadrados ordinarios.
- 2. El Modelo Lineal Generalizado.
 - 2.1. El estimador de mínimos cuadrados generalizado.
 - 2.2. Autocorrelación.
 - 2.3. Heteroscedasticidad.
- 3. El problema de la multicolinealidad.
- 4. Variables ficticias.
- 5. Tendencia y variación estacional en series de tiempo.
- 6. Modelos de rezagos distribuidos.

III. BIBLIOGRAFIA

No se asigna un texto obligatorio. Como libros de consulta se recomiendan los siguientes:

1. G.S. Maddala, Econometría, Mc Graw-Hill.
2. Johnston, Econometric Methods, Mc Graw-Hill.

En relación con algunos tópicos específicos se señalarán algunas referencias bibliográficas especializadas.

IV. EVALUACION

Con la advertencia de que está sujeto a revisión y modificación, el esquema de evaluación es el siguiente:

Dos exámenes parciales	(20% c/u)
Examen final	(25%)
Trabajo empírico	(25%)
Tareas y comprobaciones de lectura	(10%)