

UNIVERSIDAD DE LOS ANDES  
FACULTAD DE ECONOMIA  
PROGRAMA DE ECONOMETRIA

Segundo Semestre de 1991  
Prof.: Dr. Alberto Melo Giraldo

**1. 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. Judge et. al., Introduction to the Theory and Practice of Econometrics.
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% c/u)
Trabajo empírico	(25% c/u)
Tareas y comprobaciones de lectura	(10% c/u)