

PROGRAMA DE ECONOMETRIA

PROFESOR: Alvaro Montenegro García
Primer Semestre de 1996

El curso de Econometría debe proporcionar al estudiante un manejo básico de los conceptos del método científico y de la inferencia estadística relativa al análisis y modelaje de datos económicos. El trabajo teórico será complementado con ejercicios prácticos a lo largo del curso. El siguiente es el temario general:

1. Repaso de conceptos estadísticos.
2. El modelo clásico de regresión.
 - a) Supuestos del modelo.
 - b) Estimación de parámetros.
 - c) Inferencia estadística.
3. Incumplimiento de los supuestos.
 - a) Error de especificación.
 - b) Multicolinealidad.
 - c) Heteroscedasticidad.
 - d) Autocorrelación.
4. Modelos con variables limitadas.
 - a) Variables dummy.
 - b) Logit, Probit.
 - c) Censuradas, truncadas.
5. Errores en variables.
6. Ecuaciones simultáneas.
7. Tópicos en series de tiempo.
 - a) Características de las series de tiempo.
 - b) Algunos modelos.
 - c) Predicción económica.
 - d) Causalidad.
 - e) Cointegración.

Algunos textos sugeridos pero no requeridos son: (ojalá ediciones recientes).

Greene, W. Econometric Analysis.
Gujarati, D. Econometría.
Johnston, J. Econometric Methods.
Judge, G. et.al. Introduction to the Theory and Practice of Econometrics.
Kennedy P. A Guide to Econometrics.

La nota final se computará de dos exámenes (33.3% cada uno) y del resultado de los ejercicios (33.3%).