

1

**UNIVERSIDAD DE LOS ANDES
FACULTAD DE ECONOMIA**

**ECONOMETRIA
31218
Primer Semestre de 1996**

PROFESOR: ENRIQUE OSPINA GOMEZ
OFICINA: Federación Nacional de Cafeteros
Calle 73 # 8 - 13, piso 10
Tel. 217- 2879; 345-1088, ext. 732-734

INTRODUCCION Y OBJETIVOS

El curso de Econometría forma parte del Area Cuantitativa dentro de la estructura del programa de estudios de pregrado de la Facultad de Economía de la Universidad de los Andes. El contenido del curso se enfoca a la presentación de conceptos teóricos básicos y a la aplicación práctica de métodos y modelos econométricos que sirvan de apoyo al análisis económico de problemas reales y relevantes.

El curso tiene como objetivos proporcionar al estudiante:

1. Las bases teóricas para diseñar y aplicar modelos econométricos a realidades económicas y para manejar los métodos necesarios para la estimación de parámetros.
2. Las bases teóricas y prácticas necesarias para manejar información, analizar resultados e interpretar salidas de computador que sirvan como apoyo a la investigación económica.
3. Los elementos para despertar la curiosidad y el interés para avanzar en el desarrollo de conocimientos cuantitativos para analizar problemas reales y evaluar alternativas de políticas de utilidad práctica.

METODOLOGIA

El curso se presenta en sesiones de clase durante las cuales se exponen conceptos teóricos y ejemplos ilustrativos con discusiones basadas en la realidad. Se hacen prácticas de ejercicios y talleres con aplicaciones en el computador, incluyendo manejo de la información e interpretación de los resultados obtenidos. Se sugiere un texto básico en el cual el estudiante encuentra los temas del curso. Además, otros libros de consulta y artículos pertinentes a aplicaciones de tópicos de la realidad nacional están disponibles en la biblioteca para lectura.

23

EVALUACION Y CALIFICACION

- Dos exámenes parciales, cada uno el 25%
- Un examen final, el 30%
- Talleres, el 20%

CONSULTA

El Profesor está disponible para consulta de los estudiantes después de clase, por teléfono, y en la Oficina con cita previa.

TEMA

Introducción

- Métodos cuantitativos de la economía.
- Definiciones y objetivos de la econometría.
- Modelo económico y modelo econométrico.
- Componentes del modelo.
- Clasificación de variables, ecuaciones y modelos.

Conceptos Básicos de Estadística - Repaso

- Metodología de la investigación.
- Población, parámetro, muestra, marco muestral.
- Tipo de muestreo.
- Medidas de tendencia central y de dispersión.
- Hipótesis estadísticas.
- Tipos de errores.
- Procedimientos para probar hipótesis.
- Análisis de correlación.

Regresión Lineal (Simple y Múltiple)

- Función de regresión.
- Supuestos y restricciones del modelo.
- Métodos de estimación.
- Pruebas de hipótesis simples y complejas.
- Predicciones y proyecciones.
- Coeficiente de determinación.
- Intervalos de confianza.

Multicolinealidad

- Naturaleza.
- Consecuencias.

- Forma y métodos de medición.
- Medidas remediales.

Heterocedasticidad

- Naturaleza.
- Consecuencias.
- Forma y métodos de medición.
- Medidas remediales.

Autocorrelación

- Naturaleza.
- Consecuencias.
- Forma y métodos de medición.
- Medidas remediales.

Especificación del Modelo

- Concepto de especificación.
- Tipos de errores de especificación.
- Consecuencias de los errores de especificación.
- Pruebas de errores de especificación.

Modelos Autorregresivos y de Rezagos Distribuidos

- El papel del tiempo y de los rezagos en la economía.
- Modelos alternativos de rezagos distribuidos.
- Estimación de modelos autorregresivos.

Modelos con Variables Cualitativas

- Naturaleza de las variables cualitativas o binarias.
- Regresión con variables independientes cualitativas y cuantitativas.

Series de Tiempo

- Definiciones y conceptos.
- Estacionariedad, estacionalidad e invertibilidad.
- Estimación de modelos.

Modelos de Ecuaciones Simultáneas

- Conceptos y definiciones.
- Modelos y estimación.
- Ejemplos.

TEXTO SUGERIDO:

Gujarati, Damodar. 1990. Econometría. McGraw-Hill, 2a. edición.

MATERIAL DE CONSULTA

Berenson Mark; Levine David; Goldstein Mathew. 1987. Intermediate Statistical Methods and Application. A Computer Package Approach. Prentice - Hall.

Green William. 1991. Econometric Analysis. Macmillan Publishing Company.

Judge, George; Carter, Hill; Griffiths, William. 1982. Introduction to the Theory and Practice of Econometrics. John Willey & Sons. New York.

Johnston, J. 1984. Econometric Methods.

Kmenta, Jan. 1986. Elementos de Econometría. Vicens Universidad.

Kennedy, Peter. 1991. A Guide to Econometrics. The MIT Press.

Larson Harold. 1986. Introduction to Probability Theory and Statistical Inference. John Willey & Sons. New York.

Maddala, G. S. 1985. Econometría. McGraw-Hill.

Mendenhall, William. 1986. Introduction to Probability and Statistics Duxbury Press.

Manual de SAS. Última versión.

Manual de TSP. Última versión.

Mendenhall William. Introducción al Muestreo. Publishing Company, Inc., Belmont, California. 1978.

Neter, John; Wasserman, William; Kutner, Michael. 1986. Applied Linear Regression Models. Richard Irwin Inc.

Novales, Alfonso. 1993. Econometría. McGraw-Hill, segunda edición.

Pindyck, R.; Rubinfeld, D. 1981. Econometric Models and Econometric Forecasts. McGraw-Hill.