

CURSO DE ECONOMETRIA
UNIVERSIDAD DE LOS ANDES

Primer Semestre 1991

Profesor: Humberto Mora Alvarez

Objetivo del Curso: El propósito del curso es el aprendizaje de las técnicas econométricas desarrolladas a fin de estimar diferentes tipos de modelos y relaciones cuantitativas que postula la teoría económica.

Prerequisitos: El estudiante debe haber cursado álgebra lineal y estadística matemática.

Evaluación: A lo largo del curso habrá dos exámenes parciales, un examen final y un conjunto de tareas con las siguientes ponderaciones:

Primer Examen Parcial:	20%
Segundo Examen Parcial:	20%
Examen Final:	25%
Tareas:	35%

Textos: Le seguirá el texto:

"Econometric Methods", J. Johnston, third edition; Mc Graw-Hill, 1984.

Como texto auxiliar se recomienda:

"Econometric Models, Techniques, and Applications", Michael D. Intriligator, 1978, Prentice Hall.

Programa:

1. El modelo lineal simple de dos variables, el estimado por mínimos cuadrados y el teorema de Gauss-Markov.

- J. Capítulo 2
- Capítulo 3: 3.1, 3.2, 3.3

2. Extensión al modelo lineal general, propiedades del estimador por mínimos cuadrados ordinarios.

- J. Capítulo 5
- I. Capítulo 4: 4.1-4.4, 4.6, 4.8, 4.9, 4.10
- Capítulo 5: 5.1-5.6

3. Estimación del modelo lineal con restricciones lineales y test de cambio estructural.

J. 6.1, 6.2
I. 6.10

4. Desviaciones de los supuestos de Gauss-Markov:

a) Multicolinealidad

J. 6.5
I. 6.2

b) Heteroscedasticidad y correlación serial - Mínimos cuadrados generalizados y el estimador de máxima verosimilitud.

J. Capítulo 7 y 8.1-8.5
I. 4.7, 6.3, 6.4, 6.5

c) Error de especificación y errores en las variables. El estimador de variables instrumentales.

J. 6.6, 10.6
I. 6.8, 6.9

5. Combinación de observaciones temporales y de observaciones de cortes transversales.

J. 10.3

6. Variables dependientes cualitativas - Modelos Tobit y Logit

J. 10.5
I. 6.6