



ECONOMETRIA AVANZADA

1. OBJETIVO

El objetivo fundamental de éste curso es el estudio y análisis Econométrico de los modelos macroeconómicos. Los principales aspectos a tratar son: Identificación, Especificación, Integración de los Modelos con las Cuentas Nacionales y finalmente Simulación.

2. METODOLOGIA

El curso está estructurado en base a las lecturas asignadas, las exposiciones del profesor y un trabajo final de Simulación de un Modelo Econométrico.

3. BIBLIOGRAFIA

IDENTIFICACION

Johnston, Cap. 12.

Dhrymes, P. Secciones 61 - 62 y 63.

Theil, H. Secciones 9.4 y 10.2.

Malinvand, Caps. 17 y 18.

Christ, C. Cap. 8.

Koopmans. "Identificación Problems in Economic Model Construction". Cap. II en Hood y Koopmans.

MODELOS DE INSUMO-PRODUCTO

H. Chenery y P. Clark Interindustry Economics, Wiley, 1959.

Mishio Morishima, Editor, The Working of Econometric Models. Cambridge Press 1972.

R.S. Preston, The Wharton Annual and Industry Forescating Model, Univ. of Pennsylvania, 1973.



UNIVERSIDAD DE LOS ANDES
FACULTAD DE ECONOMIA
APARTADO AEREO 4976
BOGOTA - COLOMBIA

Arrieta Evaristo, Centenario, Cedano Helf, Cuentas Nacionales e Insumo-Producto: Una Aplicación para Colombia.
Rev. de Planeación y Desarrollo. Enero-Julio 1975.

MODELOS MACROECONOMICOS

L.R. Klein y A.S. Goldberger, An Econometric Model of the United States, 1929-1952, North Holland, 1955.

M.D. McCarthy, The Wharton Ouartely Econometric Foresca-
ting Model Mark III, Un. De Pa 1972.

Edwin Burmeister, y L.H. Klein Eds. Symposium on U.S.
Econometric Models, International Economic Review,
Junio 1974, Octubre 1974. Feb. 1975.

T.M. Brown, Specification and Uses of Econometric Models,

R.J. Ball, Ed., The International Linkage of National
Models, North Holland, 1973.

I. Adelman y F. Adelman, The Dynamic Properties of Elein-
Goldberger Model. Econométrica. Octubre 1959.

Johnson Keith, L. R. Klein, Link Model Simulations of
International Trade: An Evaluation of the Effects of
Currency Realignment. Journal of Finance, Mayo 1974.

Hudson Edward y Jorgenson Dale, U.S. Energy Policy and
Economic Growth, 1975-2000, The Bell Journal of
Economics, Autum, 1974.

CCRP, Modelo Seres, Estructura y Usos, Mayo 1977.

CCRP, Modelo Seres, Descripción Técnica, Enero 1975.

Rodado y Villodres, Un Modelo Macroeconómico de Colombia.
Rev. de Planeación Nacional y Desarrollo, 1969.

CCRP. Modelo Econométrico de Corto Plazo, 1977.

Dominguez, Luis R., Estimation of an Econometric Model
for México by the Method of two, Stage Least Sgnares,
Agosto 1976, (mimeo).

Marwah Kanta, An Econometric Model of Colombia: A Proto
Type Devaluation view, Econométrica, Abril 1969.



UNIVERSIDAD DE LOS ANDES
FACULTAD DE ECONOMIA
APARTADO AEREO 4976
BOGOTA - COLOMBIA

Taylor Lester, Macroeconomics and Fiscal Policy in Colombia. Rev. de Planeación y Desarrollo. Enero 1969.

Pappas James, Wise. A Model of Wisconsin's Energy Systems. Octubre 1974.

Shapiro, J.F., Decomposition Methods for Mathematical Programming Economics Equilibrium Energy Planning Models. MIT, Marzo 1977.

Danting George y Parkh S.C. On a Pilot Linear Programming Model for Assessing Physical Impact on the Economy of a Changing Energy Picture, Julio 1976.

Ramírez Manuel, Prada María Teresa, Candelo Ricardo, Forero Clemente, Metodología para Analizar el Impacto de de un Alza Exógena Sobre el Nivel General de Precios: El Caso de los Combustibles. Rev. de Planeación y Desarrollo, Enero - Junio 1975.

SIMULACION Y ANALISIS DINAMICO DE SISTEMAS ECONOMICOS

A.L. Nagar, Stochastic Simulation of the Brookings Econometric Model, The Brookings Model.

M. Otsuki, Oscillations in Stochastic Simulation of Linear Systems Economic Studies Quarterly, 1981.

I. y F. Adelman, The Dynamic Properties of the Klein-Goldberger Model, Econometrica, 1959.

B.G. Hickman Ed. Econometric Models of Cyclical Behavior, 1972.

E.P. Howrey, Stochastic Properties of the Klein - Golber - ber Model, Econometría 1971.

E.P. Howrey y L.R. Klein, Dynamic Properties of Nonlinear Econometric Models, ER. 1972.

L.R. Klein, Dynamic Analysis of Economic Systems, International Journal Math. Educ. Science Technology, Vol. 4 1973.

Estimation of Interdependent Systems in Macroeconometría, Econometría, Abril 1969.



TEXTOS DE REFERENCIA

P. Dhrymes, Econometrics, 1974.

F. Fisher, The Identification Problems in Econometrics 1966.

L.R. Klein, A Textbook in Econometric, 1974.

J. Johnston, Econometric Methods, 1971.

H. Thell, Principles of Econometrics, 1971.

L.R. Klein, An Introduction to Econometrics, 1962.

K.F. Wallis, Topics in Applied Econometrics, Gray - Mills, 1973.

J. Gramer, Empirical Econometrics, North-Holland, 1969.

J. Kmenta, Elements of Econometrics MacMillan, 1971.

L.R. Klein, An Introduction to Econometric Forecasting and Forecasting Models, 1980. Cap. I y II.

4. SISTEMA DE EVALUACION

Primer Exámen Parcial	20%
Segundo Exámen Parcial	30%
Trabajo Final	50%

5. MATRIZ DE CONTENIDO

Capítulo	Descripción del Tema	Ulas			Total
		A	B	C	
I	Identificación	12	8		20
II	Modelos de Insumo-Producto	4	2.6		6.6
	A. Definición				
	B. Relación con Funciones de Producción.				
	C. Cambio de los Coeficientes				



UNIVERSIDAD DE LOS ANDES
 FACULTAD DE ECONOMIA
 APARTADO AEREO 4976
 BOGOTA - COLOMBIA

<u>Capítulo</u>	<u>Descripción del Tema</u>	<u>ULAS</u>			<u>TOTAL</u>
		A	B	C	
III	Modelos Macroeconómicos.	32	21.4		53.4
	A. Integración de las Cuentas Nacionales y los Modelos de Insumo-Producto.				
	B. Modelo Internacional.				
	C. Modelo de Energía				
IV	Simulación y Análisis Dinámico de Sistemas Económicos	12	8		20
	A. Solución				
	B. Simulación no Estocástica y Estocástica.				
	C. Análisis de Multiplicadores.				
	C. Análisis de Ciclos.				
	Total	60	40		100