

UNIVERSIDAD DE LOS ANDES
Facultad de Economía

ECONOMETRIA P E G.

Segundo Semestre 1986

OBJETIVO

El Curso está orientado a la discusión de temas avanzados de la teoría y métodos de econometría. Se dará especial énfasis en el estudio de las metodologías para el tratamiento de las series de tiempo.

MÉTODOS DE TRABAJO

El Curso se desarrollará en torno a las exposiciones y discusiones en clase. Adicionalmente se asignarán ejercicios prácticos y lecturas, Para la realización de los ejercicios se requiere la utilización del computador y de paquetes estadísticos disponibles en el centro de cómputo de la Universidad.

EVALUACION

La evaluación de los estudiantes se hará con base en cuatro (4) exámenes parciales (30%), el examen final (25%), los ejercicios (30%) y algunos "quiz" (15%).

PLAN DE TEMAS

Repaso modelo Uniecuacional

Modelos de ecuaciones Simultáneas: La Identificación, tipología de los modelos.

Estimación de cada ecuación (parcial 2)

Estimación Conjunta del modelo, métodos de información completa.

Modelos de rezagos distribuidos

Modelos dinámicos, ecuaciones de diferencia.

Condiciones de estabilidad. Análisis de Multiplicadores (Parcial 3)

Series de Tiempo. Modelos Determinísticos

Procesos Estocásticos; modelos estocásticos

RECESO

Modelos Lineales AB, MA. ARMA, ARIMA

Estimación (Parcial 4)

Predicción con Modelos de Series de Tiempo

Combinación de Modelos de Series de tiempo y modelos de regresión.

Modelos de Elección Cualitativa, Logit, Probit, Tobit.

Otros Temas

Exámenes Finales