

ECONOMETRIA

Profesor

Martha Misas A. 93-I

Descripción:

El curso será una introducción a la econometría que le permitirá al estudiante conocer y trabajar las herramientas básicas econométricas, como también, adquirir conceptos fundamentales para el entendimiento de técnicas avanzadas en cursos posteriores. La naturaleza del curso será fundamentalmente estadística y matemática.

Los prerrequisitos para este curso son Estadística y Algebra de Matrices. Este último debe ser tomado seriamente ya que los desarrollos se realizarán bajo especificaciones matriciales.

El curso tendrá tres partes fundamentales: teoría, ejercicios y prácticas de computador.

Texto:

Introduction to the Theory and Practice of Econometrics.

Judge, et all.

Wiley, 1988

Los primeros 4 capítulos son un buen repaso de Estadística que cada estudiante debe realizar en la medida que lo considere necesario.

El apéndice A "Linear Algebra and Matrix Methods" debe ser estudiado a fin de asegurar el buen entendimiento en la clase.

Temas:

Mínimos Cuadrados Ordinarios (OLS)

Modelo Lineal:

Principios básicos	5.1-5.5
Propiedades de β	5.6-5.8
Predicción	5.9
Variables Dummy	10.1-10.3
Multicolinealidad	21
Polinomio de Rezagos Distribuidos	17.1-17-3

Modelo Lineal General (GLS)

Estimación de Máxima Verosimilitud	6.1
Estimación de Restricciones	6.2
Estimación de Intervalos	6.3
Chequeo de Hipótesis	6.4
Con Σ conocido	8.1 8.3-8.10
Autocorrelación	9.4 9.5-9.7
Heterocedasticidad y SUR	9.1-9.3.3 9.3.6-9.4 11.3.1 11.3.2

Modelo de Ecuaciones Simultáneas¹

Econometría Básica: Damodar Gujarati.	17-18-19
---------------------------------------	----------

¹ Este tema es opcional.

Calificaciones:

3 parciales (Fijados oportunamente)	60%
Tareas y prácticas de computador	20%
Exámen final	20%

Las tareas y prácticas de computador deben ser entregadas en grupo (máximo de 3 estudiante)

Paquetes Econométricos que pueden ser utilizados en el trabajo en computador:

- Gauss
- TSP
- SAS
- RATS

Referencia Bibliográfica:

Econometrics Maddala
 Elementos de Econometría Jan Kamenta
 Métodos de Econometría J. Johnston
 Econometría Básica Damodar Gujarati
 A Guide to Econometrics P. Kennedy
 Modelos Econométricos R. Pindyck y D. Rubinfeld.