

1

ECONOMETRIA
1994 I SEMESTRE

Profesora
Martha Misas A.

Profesor Asistente
Norberto Rodríguez N.

Prerrequisitos:

Los temas por desarrollar en este curso exigen conocimientos de Estadística y Algebra de Matrices. Se recomienda, por tanto, hacer un buen repaso de estos tópicos. (Capítulos 2, 3 y 4 del libro texto).

Descripción:

El curso será una introducción a la econometría que permitirá 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 esencialmente teórico estadística y práctica en la medida en que el estudiante realice trabajos fuera de clase.

El curso se dividirá en tres partes: teoría, ejercicios y prácticas de computador.

Texto Básico:

Econometric Analysis. William Greene, MacMillan.

Textos recomendados:

Introduction to the Theory and Practice of Econometrics. Judge et all. Wiley, New York, 1988, Second Edition.

A Guide to Econometrics. P. Kennedy.

Econometric Models and Economic Forecasts. Pindyck, R and Rubinfeld, D. McGraw-Hill. 1992, Third Edition.

Temas:

Capítulo	Tema
5	Mínimos Cuadrados Ordinarios (OLS)
6	Regresión Múltiple
7	Test de hipótesis sobre modelos de regresión múltiple
9	Multicolinealidad
13	Mínimos cuadrados generalizados
14	Heterocedasticidad
15	Autocorrelación

Calificaciones:

2 parciales (Fijados oportunamente)	40%
Quices (No avisados)	20%
Tareas y prácticas de computador	20%
Examen final	20%

(Dichos porcentajes no serán modificados)

Paquetes:

- GAUSS
- MATLAB
- SAS
- RATS