

OK
1/3

BIBLIOGRAFÍA

Objetivo: Familiarizar al estudiante con otros métodos importantes en el análisis econométrico.

Metodología: En lo posible para cada tema hay una clase magistral y otra de ejercicios. Los ejercicios se asignarán el día de la clase magistral y la idea es que los estudiantes los puedan trabajar antes de la clase de ejercicios. Se usará como texto guía el de Greene y como lectura obligatoria el de Gujarati. El libro de Greene tiene una buena introducción formal a los temas tratados, y el libro de Gujarati tiene buenos ejemplos y ejercicios económicos relacionados. Los ejercicios se sacarán de los textos y de los libros en la bibliografía.

Prof: Liliana Garrido

Textos: Greene. Econometric Analysis, Fourth Edition, Prentice Hall, 1999

Gujarati. Basic Econometrics, Third Edition, McGraw-Hill

Contenido

Fecha

Enero

- 17 Repaso, errores autocorrelacionados
- 1 Modelos de Series de Tiempo y Corte Transversal
- Ju 24 Continuación, ejercicios
- Lu 28 Modelos con coeficientes que varían a lo largo del tiempo y transversalmente
- Ju 31 Continuación, ejercicios

Febrero

- Lu 4 Sistemas de ecuaciones de regresión
- Ju 7 Continuación, ejercicios
- Lu 11 Repaso, parcial 1
- Ju 14 Modelos de Series de Tiempo. Procesos Estocásticos estacionarios
- Lu 18 Procesos integrados y Diferenciación, Caminatas aleatorias, Regresión Espúrea, Raíces unitaras, Cointegración
- Ju 21 Continuación, ejercicios
- Lu 25 Modelos GARCH
- Ju 28 Continuación, ejercicios

Marzo

- Lu 4 Modelos de regresión dinámicos
- Ju 7 repaso, parcial 2
- Lu 11 Continuación
- Ju 14 Ejercicios
- Último día de retiro de materias
- Lu 18 VAR
- Ju 21 Continuación, ejercicios

Semana Santa 25-29

Abril

- Lu 1 Modelos de Ecuaciones Simultáneas, Introducción, notación
- Ju 4 Continuación, ejercicios
- Lu 8 El problema de identificación
- Ju 11 Continuación, ejercicios
- Lu 15 Métodos de estimación
- Ju 18 Continuación, ejercicios
- Lu 22 Repaso, Parcial 3
- Ju 25 Modelos con variables dependientes discretas
- Lu 29 Continuación, ejercicios
- Ju 2 Continuación, ejercicios

Mayo 6 al 18 Exámenes finales

Porcentaje de las evaluaciones: 3 parciales 20% cada uno, tareas 20%, examen final 20%.

Forma de aproximación final: $A.25 \leq \text{nota} < A.75$ se aproxima a A.5, $A.75 \leq \text{nota} < A.25$ se aproxima a A; esto si $\text{nota} \geq 1.5$. Si $\text{nota} < 1.5$ se aproxima a 1.5

BIBLIOGRAFÍA.

Judge, Griffiths W. Et al. Introduction to the Theory and Practice of Econometrics. Second edition, John Wiley & Sons, 1988
 Judge, Griffiths W. Et al. The Theory and Practice of Econometrics. Wiley, Second Edition, 1985
 Judge, Griffiths, Hill. Learning and Practicing Econometrics. Wiley, 1993.
 Greene. Econometric Analysis. Fourth Edition, Prentice Hall, 1999.
 Novales Alfonso. Econometría. Segunda Edición, McGraw-Hill, 1993.
 Maddala. Introducción a la Econometría. Prentice Hall. Segunda Edición, 1996.
 Gujarati. Basic Econometrics. Third Edition. McGraw-Hill.
 Harvey. The Econometric Analysis of Time Series. Second Edition. Philip Allan.
 Bierens. Topics in Advanced Econometrics. Cambridge University Press.
 Enders Walter. Applied Econometric Time Series. Wiley, 1995
 Johnston, Dinardo. Econometric Methods, Fourth Edition, McGraw-Hill, 1997

Contenido

Mayo 6 al 18	Exámenes finales
Ju 2	Continuación, ejercicios
Ju 29	Continuación, ejercicios
Ju 26	Modelos con variables dependientes discretas
Ju 23	Reposo, Parcial 2
Ju 18	Continuación, ejercicios
Ju 15	Métodos de estimación
Ju 11	Continuación, ejercicios
Ju 8	El problema de identificación
Ju 4	Continuación, ejercicios
Ju 1	Modelos de Ecuaciones Simultáneas, Introducción, notación
Abril	
Semana Semts 25-29	
Ju 21	Continuación, ejercicios
Ju 18	VAR
Ju 15	Último día de retiro de materias
Ju 11	Ejercicios
Ju 11	Continuación
Ju 7	Reposo, parcial 2
Ju 4	Modelos de regresión dinámicos
Mayo 29	
Ju 26	Continuación, ejercicios
Ju 23	Modelos GARCH
Ju 21	Continuación, ejercicios
Ju 18	Procesos integrados y Diferenciación, Camaratas estocásticas, Regresión Espérea, Raíces unitarias, Cointegración
Ju 14	Modelos de Series de Tiempo, Procesos Estocásticos estacionarios
Ju 11	Reposo, parcial 1
Ju 7	Continuación, ejercicios
Ju 4	Sistemas de ecuaciones de regresión
Febrero	
Ju 31	Continuación, ejercicios
Ju 28	Modelos con coeficientes que varían a lo largo del tiempo y transverzales
Ju 24	Continuación, ejercicios
Ju 21	Modelos de Series de Tiempo y Correlación Transversal
Ju 17	Reposo, errores autocorrelacionados
Enero	
Fecha	