

PROGRAMA

ECONOMETRIA II - POSTGRADO

II/81

Horario: Martes - Jueves

4 - 6 p.m.

Salón : B-309

Profesor: Dr. Harold Banguero L.

Objetivos

1. Profundizar en aspectos teóricos y técnicas econométricas ya conocidas por el estudiante pero no suficientemente asimiladas.
2. Familiarizar al estudiante con nuevas técnicas de análisis económico de desarrollo reciente.
3. Desarrollar la habilidad del estudiante para hacer aplicaciones de la teoría y los métodos econométricos al análisis de problemas económicos en el ámbito colombiano.

Metodología

El curso tendrá un balance entre teoría y aplicaciones. Los estudiantes recibirán clases teóricas para ampliar conocimientos y harán aplicaciones de la teoría y las técnicas en el análisis de un problema tomado de la realidad colombiana.

Temas y Contenidos

c

Repaso1. Teorías y Modelos (2 secciones)

- a) Definición de modelos.
- b) Especificación de modelos.
- c) Componentes de los modelos.
- d) Tipos de modelos.
- e) Condiciones lógicas de un modelo.
- f) Uso de los modelos.

(Primer ejercicio 10%).

2. Los Datos (1 sesión)

- a) Definición
- b) Clases de datos.
- c) Ajuste de datos.
- d) Fuentes de datos en Colombia.

(Segundo ejercicio 10%)

3. El Modelo de Regresión Múltiple . Los Problemas. Soluciones
(3 sesiones)

- a) Definición
- b) Estimación de coeficientes.

- c) Bondad de ajuste.
- d) Test de significancia
- e) Problemas
 - i. Errores en variables
 - ii. Heterocedasticidad.
 - iii. Autocorrelación de Residuos.
 - iv. Multicolinealidad.
- f) Mínimos cuadrados generalizados.

(Tercer ejercicio 10%)
Primera Evaluación Parcial 15%

Temario Nuevo

4. Modelos Especiales (3 sesiones)

- a. Modelos dinámicos con rezagos.
- b. Modelos con variables "Dummy"
- c. Modelos Logit - probit.

(cuarto ejercicio 10%)
Segunda Evaluación Parcial 15%

5. Modelos Simultáneos Lineales (6 sesiones)

- a. Identificación
- b. Especificación
- c. Técnicas de estimación
 - mínimos cuadrados indirectos.
 - mínimos cuadrados en dos etapas
 - máxima verosimilitud.

(cuarto Ejercicio 10%)

6. Simulación (1 sesión)

- a. Definición
- b. Técnicas
- c. Aplicaciones

(tercera evaluación parcial 20%)

7. (Opcional). Modelos no lineales (Introducción)

- a. Simples
- b. Simultáneos.
- c. Técnicas de estimación.
- d. Aplicaciones.

Evaluación

50% Exámenes Parciales así:

1er parcial = 15%
2º parcial = 15%
3er parcial = 20%

50% Ejercicios así:

- 1er Ejercicio = 10%
- 2º Ejercicio = 10%
- 3º Ejercicio = 10%
- 4º Ejercicio = 10%
- 5º Ejercicio = 10%

Bibliografía

Se elaborarán conferencias escritas sobre todos los temas, las cuales podrán ser xeroxcopiadas por los estudiantes que lo deseen.

Además, se darán referencias adicionales para cada tema en la clase.