

UNIVERSIDAD DE LOS ANDES
Facultad de Economía

PROGRAMA DE ECONOMIA PARA GRADUADOS
Econometría II

Segundo Semestre de 1982.

Profesor : Eduardo Ramírez.
Profesor Asistente: Claudia Correa O.

PRIMERA PARTE. El Modelo Clasico.

I. Repaso de conceptos estadísticos y matemáticos.

- 1.1 Elementos de cálculo matricial.
Matrices definidas positivas, matrices idempotentes. Derivadas
- 1.2 Estadística matemática en forma matricial.
Valor esperado. Matriz de Varianza Covarianza. Valor esperado y varianza de una forma cuadrática. Formas lineales y formas cuadráticas en variables normales. Independencia de formas cuadráticas y lineales en variables normales

II. Especificación.

Evolución histórica, objeto y método de la econometría. Modelos Económicos y Modelos Econométricos.

III. Modelo de Regresión Múltiple.

- 3.1 El modelo y sus hipótesis
- 3.2 Estimación y propiedades de los estimadores
- 3.3 El teorema de Gauss-Markov.
- 3.4 Coeficientes de correlación múltiple.

IV. Inferencia Estadística en el Modelo de regresión múltiple

- 4.1 Resultados elementales.
La hipótesis de normalidad. Estimadores de máxima verosimilitud. Teorema de independencia. Test individuales sobre los coeficientes de regresión.
- 4.2 Teoría general del Test de hipótesis lineal.

SEGUNDA PARTE. Violación de los supuestos del Modelo Clásico.

V. Multicolinealidad.

- 5.1 Naturaleza.
- 5.2 Consecuencias.
- 5.3 Como destacarla.
- 5.4 Medidas remediales.

VI. Heteroscedasticidad.

- 6.1 Naturaleza.
- 6.2 Consecuencias.
- 6.3 Como destacarla.
- 6.4 Medidas remediales.

VII. Autocorelación.

- 7.1 Naturaleza.
- 7.2 Consecuencias.
- 7.3 Como destacarla.
- 7.4 Medidas remediales.

TERCERA PARTE. Ecuaciones Simultaneas.

VIII. Descripción del Sistema

- 8.1 Introducción.
- 8.2 Estructura.
- 8.3 La forma reducida.
Derivación, propiedades estadísticas, interpretación económica.

IX. El Caracter Simultaneo del Sistema.

- 9.1 Sesgo debido a la simultaneidad.
- 9.2 Introducción a los metodos de estimación.
Minimos cuadrados indirectos. Minimos cuadrados dobles
Maxima verasimilitud, con información completa. El estimador
de clase K., Minimos cuadrados triples.

X. Identificación.

BIBLIOGRAFIA.

1. - D. Gujarati. Econometría Básica.
2. - J. Johnston. Metodos - Econometricos.
3. - A.S. Goldberger. Econometric Theory.
4. - R. Wonnacott and Wonnacott. Econometrics
5. - C. Dagum y E. de Dagum. Introducción a la Econometría.