

UNIVERSIDAD DE LOS ANDES
Facultad de Economía

ECONOMETRIA AVANZADA

Profesor: Bernardo Kugler
Primer Semestre de 1984

Libros:

- PR: Econometric Models and Economic Forecasts
Pindyck & Rubinfeld (1a. Ed.) McGraw-Hill
- M: Econometrics. Maddala. McGraw-Hill
- G: Econometrics Theory. Goldberger Wiley
- J: Econometric Methods- Johnston (1a. Ed) McGraw-Hill
- T: Principles of Econometrics. Theil. Wiley
- Ma: Statistical Methods of Econometrics. Malinvaud. Rand Mc.
Nally.
- HK: Studies in Econometric Method. Hood & Koopmans. Wiley.

Tipos de Lecturas:

- * Sugerida
- ** Sustituta de la sugerida
- *** Complementaria

Textos de Estadística:

- HC: Introduction to mathematical Statistics. Hogg & Craig
- L: Statistical Theory. Lindgren
- MG: Introduction to the Theory of Statistics. Mood & Graybill

1. Repaso de Estadística (Inferencia, Estimación, contrastes de hipótesis) y Álgebra Lineal.

T: Cap. 1 y 2 *

G: Cap. 2 y 3 **

HC: MG, L. **

M: Cap. 2-4 ***

2. Repaso de Econometría Introdutoria

2.1 Introducción: causalidad, teoría, modelos y datos

T: Cap. 0 *

Ma: Cap. 2 *

HK: Cap. 2 Nos. 1,2,3 *

PR: Intr. *

G: Cap. 1 ***

M: Cap. 1 ***

2.2 El Modelo Clásico de regresión de una ecuación

PR: Cap. 2 y 3 *

M: Cap. 7 y 8 **

J: Cap. 1 a 4 **

G: Cap. 4 **

T: Cap. 3 y 4 **

Ma: Cap. 5 a 8 ***

3. El modelo generalizado de regresión uniecuacional

3.1 Teoremas Gauss-Markow - Aitken

PR: Cap. 4 apéndice *

G: Cap. 5.4 **

T: Cap. 6.1 ***

3.2 Heteroscedasticidad y Autocorrelación de residuos

PR: Cap. 4 *

M: Cap. 12 **

G: Cap. 5.4 **

J: Cap. 7, 8.4 **

T: Cap. 6.2 - 6.3 ***

3.3 Formas funcionales

PR Cap. 3.8 *

G: Cap. 5.2 *

J: Cap. 8.4 **

M: Cap. 9 ***

Ma: Cap. x ***

T: Cap. II ***

3.4 Otros temas (errores en variables, error de especificación, Retagos distribuidos, Predicción)

PR: Cap. 5.2, 7.1, 7.4, 6 *

M: Cap. 9.3, 9.5, 13, 15, 16 **

J: Cap. 6, 6.3 **

T: Cap. 6.3, 6.4, 6.5 ***

Ma: Cap. 15 ***

4. Ecuaciones simultáneas

4.1 El problema de identificación

PR: Cap. 5.1, 5.3, 5.4, 5.5, 9.1, 9.2, Apéndice 9.1 *

M: Cap. 11.1, 11.2, 11.3, 11.4 *

J: Cap. 9.1- 9.2 **

G: Cap. 7.1, 7.2, 7.3, 7.4 **

HK: Cap. 2, No. 11 **

T: Cap. 9.1, 9.2, 9.3, 9.4 ***

4.2 Estimación de Modelos simultáneos

PR: Cap. 9.3, 9.4, 9.5 + Apéndices 9.2, 9.3, 9.4 *

M: Cap. 11.5, 11.6, 11.7, 11.9 *

J: Cap. 9.3, 9.5, 9.8 **

G: Cap. 7.5, 7.6, 7.7, 7.8 **

HK: Cap. 6 **

T: Cap. 9.5, 9.6, Cap. 10 ***

5. Opcional: Temas especiales

5.1 Variables dependientes cualitativas

PR: Cap. 8

T: Cap. 12.5

G: Cap. 5.5

5.2 Construcción de modelos

PR: Cap. 10, 11, 12, 13, 14, 15, 16, 17

M: Cap. 15

5.3 Modelos en desequilibrio

Econometric Reviews. Vol. 1, No. 1 Quandt

Lista de algunos artículos sobre Colombia

Desarrollo y Sociedad No. 1. Pobreza y dualismo en el sector Urbano de las economías en Desarrollo: El caso de Colombia. F. F. Bourguignon.

No. 6. El racionamiento de crédito en Colombia: Un análisis a nivel de empresa. James Tybout.
La participación de las madres en el mercado de trabajo urbano en Colombia. Tarsicio Castañeda.

Revista de Planeación y Desarrollo. XIV No. 2. 1982. El enfoque monetario de la balanza de pagos. El caso de Colombia. 1968-80 G. Montes & R. Candelo.
Efecto de los sindicatos en la Economía Colombiana. León, Rodríguez & Cano.

XIII- No. 3. 1981. La edificación de la vivienda en Colombia. UPG- UDRU. Un Modelo econométrico para la ganadería de carne en Colombia. 1950-70 Gutiérrez - de Boer. Ospina.

XIV- No. 1. 1982. Diferencias de ingreso entre ramas de actividad en Colombia: Una aplicación del Modelo de capital humano. León.

La nutrición como determinante del rendimiento escolar en Colombia. H. Banguero.

X. No. 2. 1978. Un modelo de Corto Plazo para la Economía Colombiana. Reyes, Kugler, Ramírez, Sarmiento, Rubio.

VI. 1974. Efectos de la Educación sobre los ingresos del trabajo. B. Kugler.

García, Jorge. The effects of exchange rates and commercial policy on agricultural incentives in Colombia. IFPRI. Jun. 81.

Bourguignon & Leibovich. Supply & demand factors in development: an aggregate disequilibrium model applied to Colombia. U. de Economie Politique.

- 5 -

Kugler, Reyes, Gómez. Educación y Mercados de Trabajo Urbanos
una comparación entre sectores modernos y no modernos.
CCRP, Monografía No. 10.

El sistema colombiano de Ahorro y Vivienda. S. de I. & Econ.
B.C.H.