

UNIVERSIDAD DE LOS ANDES
Facultad de Economía

ECONOMETRIA P E G.

Profesor: JAIME OUEVEDO
Primer Semestre 1986

OBJETIVO

El curso está orientado a la discusión de temas avanzados de la teoría y métodos de econometría. Se dará especial énfasis en el estudio de las metodologías para el tratamiento de las series de tiempo.

MÉTODOS DE TRABAJO

El curso se desarrollará en torno a las exposiciones y discusiones en clase. Adicionalmente se asignarán ejercicios prácticos y lecturas. Para la realización de los ejercicios se requiere la utilización del computador y de paquetes estadísticos disponibles en el centro de cómputo de la Universidad.

EVALUACION

La evaluación de los estudiantes se hará con base en cuatro (4) exámenes parciales (30%), el examen final (25%), los ejercicios (30%) y algunos "quiz" (15%).

PLAN DE TEMAS

Mes	Semana	Tema
Enero	4, Feb.1	Repaso modelo uniecuacional
Febrero	2	Modelos de Ecuaciones Simultáneas: la identificación, tipología de los modelos.
	3	Estimación de cada ecuación (parcial 2).
	4	Estimación conjunta del modelo, métodos de información completa.
Marzo	1	Modelos de rezagos distribuidos
	2	Modelos Dinámicos, ecuaciones de diferencia
	3	Condiciones de Estabilidad. Análisis de multiplicadores (parcial 3).

- 2 -

Mes	Semana	Tema
Abril	1	Series de tiempo; modelos determinísticos
	2	Procesos estocásticos; modelos estocásticos
	3	RECESO
	4	Modelos lineales AR, MA, ARMA, ARIMA. Estimación (Parcial 4).
	5	Predicción con modelos de series de tiempo. Combinación de modelos de series de tiempo y <u>mo</u> delos de regresión.
Mayo	1	Modelos de elección cualitativa. Logit, Probit, Tobit.
	2	Otros temas Exámenes finales