

31218 - PROGRAMA DE ECONOMETRIA

18

PROFESOR: CARLOS GERARDO MOLINA

SEGUNDO SEMESTRE 1988

3-08-88

OBJETIVO

El curso está orientado hacia el análisis de regresión. Inicialmente se estudiará la estimación y verificación de los modelos univariados. Posteriormente se trabajará sobre los modelos de varias variables, estudiando sus supuestos básicos y las medidas correctivas que deban emplearse en caso de su incumplimiento. Se dará también una introducción a otros temas econométricos, tal el caso de los modelos de ecuaciones simultáneas.

METODO DE TRABAJO

Semanalmente se harán dos sesiones de trabajo en las cuales, a través de exposiciones y discusiones orientadas por el profesor y basadas en una activa participación del estudiante, se desarrollarán la teoría y algunos ejercicios de aplicación. El estudiante, con base en el programa del curso, preparará previamente el material asignado a cada sesión de clase. Buena parte de los ejercicios y en especial el trabajo final, requerirán el uso del computador. Complementariamente y con la ayuda de un profesor asistente, se adelantarán sesiones extras de trabajo, bajo la modalidad de taller, que permitirán al estudiante profundizar en algunos temas de interés y ahondar en un tema de investigación, el cual se convertirá en su trabajo final.

EVALUACION

Primer parcial:	20%
Segundo parcial:	20%
Examen final	20%
Quices y tareas	10%
Trabajo final y trabajo en talleres:	30%

Se anota que no se harán exámenes adicionales y que las fechas de estos son inmodificables.

PLAN DE TEMAS

Mes	Semana	Tema
Agosto	1	Introducción y conceptos básicos
	2,3	Modelo univariado: supuestos, estimación y propiedades. Ejercicios/
	4	Pruebas de hipótesis y análisis de varianza
Septiembre	5	Ejercicios y Parcial I
	6	Repaso notación matricial
	7,8	Modelos multivariados: supuestos, estimación y propiedades. Ejercicios
Octubre	9,10	Análisis de varianza y pruebas de hipótesis, Parcial II.
	11	Multicolinealidad
	12	Heteroscedasticidad

Noviembre	13	Autocorrelación
	14	Variables dicotomas. Modelos con rezagos
	15	Introducción Ecuaciones simultaneas
	16	Exposición trabajos finales

Texto Recomendado: "Econometría Básica". Damodar Gujarati, Mc Graw-Hill
Latinoamericana

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTARIA

Maddak, G.S. Econometrics. International Student Edition. MacGraw-Hill.

330.018
M179e

Pindyck R.S. y Rubin Feld. D.L., Econometric modelo and economic
Forecasts. International Student Edition. MacGraw-Hill

338.544
P648e

Wonnacolt, R. and Wonnacott. Econometrics. Wiley International Edition

330.0151
W872e

Mailler, P. L'econometrie. que sais-je? Presses universitaires de
France (Puf), 1971.

Serrano, J., Análisis de Regresión, I.I. Universidad de los Andes

Aldana, E. Modelos estadísticos, I.I.

" " " "

310.07
A357

eder.