

31218 - PROGRAMA DE ECONOMETRIA

PROFESOR: ALVARO MONTENEGRO

SEGUNDO SEMESTRE 1990

El curso de Econometría debe proporcionar al estudiante un manejo básico de los conceptos del método científico y de la inferencia estadística relativa al análisis y modelaje de datos económicos. El trabajo teórico será complementado con talleres y ejercicios prácticos. El siguiente es el temario general del curso.

1. Repaso de conceptos estadísticos y algebra lineal .
2. El modelo clásico de regresión
 - a) Supuestos del modelo
 - b) Estimación de parámetros
 - c) Inferencia estadística
3. Incumplimiento de los supuestos
 - a) Heteroscedasticidad
 - b) Autocorrelación
 - c) Mínimos cuadrados generalizados
 - d) Multicolinealidad
4. Variables dummy y datos de corte transversal
5. Tópicos en series de tiempo
 - a) Características de las series de tiempo
 - b) Algunos modelos
 - c) predicción económica

Algunos textos sugeridos pero no requeridos son:

Maddala, G. Econometría

Gujarati, D. Econometría Básica

Johnston, J. Econometría Methods,

La nota final se computa de tres exámenes (25% cada uno) y de un trabajo empírico (25%).
