

UNIVERSIDAD DE LOS ANDES
FACULTAD DE ECONOMIA
PROGRAMA DE ECONOMETRIA

PRIMER SEMESTRE DE 1992
PROF.: DR. ALBERTO MELO GIRALDO

1. **OBJETIVOS:**

El curso se propone dos objetivos:

- i) Proporcionar a los estudiantes los elementos teóricos fundamentales de la econometría.
- ii) Brindar a los estudiantes la posibilidad de desarrollar una primera experiencia práctica, relativamente intensiva, con las técnicas econométricas relacionadas con el modelo de regresión lineal.

II. **CONTENIDOS:**

- 1. El Modelo Lineal General y el estimador de mínimos cuadrados ordinarios.
- 2. El Modelo Lineal Generalizado.
 - 2.1. El estimador de mínimos cuadrados generalizado.
 - 2.2. Autocorrelación
 - 2.3. Heteroscedasticidad
- 3. El problema de la multicolinealidad.
- 4. Variables ficticias.
- 5. Tendencia y variación estacional en series de tiempo.
- 6. Modelos de rezagos distribuidos.

III. **BIBLIOGRAFIA:**

No se asigna un texto obligatorio. Como libros de consulta se recomiendan los siguientes:

- 1. Judge et. al. Introduction to the Theory and Practice of Econometrics.
- 2. Johnston, Econometric Methods, Mc Graw-Hill.

2

En relación con algunos tópicos específicos se señalarán algunas referencias bibliográficas especializadas.

IV. **EVALUACION:**

Con la advertencia de que está sujeto a revisión y modificación, el esquema de evaluación es el siguiente:

Dos exámenes parciales	(20% c/u)
Examen final	(25%)
Trabajo empírico	(25%)
Tareas y comprobaciones de lectura	(10%)

Santafé de Bogotá, D.C., 14 de enero de 1992