

UNIVERSIDAD DE LOS ANDES
Facultad de Economía

31218 - PROGRAMA DE ECONOMETRIA

PROFESOR: ALVARO MONTENEGRO GARCIA
PRIMER SEMESTRE DE 1992

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 a lo largo del curso. El siguiente es el temario general:

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) Error de especificación
 - b) Multicolinealidad
 - c) Heteroscedasticidad
 - d) Autocorrelación
4. Variables dummy, logit y probit
5. Errores en variables
6. Ecuaciones simultáneas
7. 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: (ojalá ediciones recientes)

Gujarati, D. Econometría
Maddala, G. Econometría
Johnston, J. Econometric Methods
Judge G. et al. Introduction to the Theory and practice of Econometrics

La nota final se computará de dos exámenes (33.3% cada uno) y del trabajo empírico (33.3%).