

UNIVERSIDAD DE LOS ANDES

FACULTAD DE ECONOMIA

ECONOMETRIA

Segundo Semestre de 1995

PROFESOR: *Enrique Ospina Gómez*
OFICINA: *Federación Naional de Cafeteros*
TELEFONO: *217 - 2879*
HORA: *7 - 9 A.M.*
SALON:

INTRODUCCION Y OBJETIVOS

El curso de Econometría forma parte del Area Cuantitativa dentro de la estructura curricular de la Facultad de Economía de la Universidad de los Andes. El contenido del curso está enfocado hacia la presentación de conceptos teóricos básicos y a la aplicación de metodos y modelos econométricos que sirvan de apoyo al análisis de información económica.

Los objetivos del curso son:

- 1. Proporcionar al estudiante las bases teóricas para diseñar y aplicar modelos econométricos a realidades económicas y para manejar los métodos necesarios para la estimación de parámetros.*
- 2. Proporcionar al estudiante las bases necesarias para manejar información, analizar resultados e interpretar salidas de computador que sirvan como apoyo a la investigación económica.*
- 3. Suministrar elementos que sirvan para despertar la curiosidad y el interés para avanzar en el desarrollo de conocimientos cuantitativos para analizar problemas reales y evaluar alternativas de políticas de utilidad práctica.*

METODOLOGIA

El curso será presentado en sesiones de clase durante las cuales se expondrán conceptos teóricos y ejemplos ilustrativos con discusiones basadas en la realidad. Se harán prácticas de ejercicios y talleres con aplicaciones en el computador, incluyendo manejo de la información e interpretación de los resultados obtenidos. Artículos pertinentes a aplicaciones de tópicos de la realidad nacional estarán disponibles en la biblioteca para lectura al igual que otros textos de interés.

EVALUACION Y CALIFICACION

- *Dos exámenes parciales aportarán cada uno el 25%*
- *El examen final aportará el 30%*
- *Ejercicios y talleres el 20%*

TEMA

Introducción

- *Métodos cuantitativos de la economía*
- *Definiciones y objetivos de la econometría*
- *Modelo económico y modelo econométrico*
- *Componentes del modelo*
- *Clasificación de variables, ecuaciones y modelos*

Conceptos Básicos de Estadística

- *Metodología de la investigación*
- *Población, parámetro, muestra, marco muestral*
- *Tipo de muestreo*
- *Medidas de tendencia central y de dispersión*
- *Hipótesis estadísticas*
- *Hipótesis nula y alterna*
- *Tipos de errores*
- *Procedimientos para probar hipótesis*
- *Análisis de correlación*

Regresión Lineal (Simple y Múltiple)

- *Función de regresión*
- *Supuestos y restricciones del modelo*
- *Métodos de estimación*
- *Pruebas de hipótesis simples y complejas*
- *Predicciones y proyecciones*
- *Coefficiente de determinación*

- *Intervalos de confianza*

Multicolinealidad

- *Naturaleza*
- *Consecuencias*
- *Forma y métodos de medición*
- *Medidas remediales*

Heterocedasticidad

- *Naturaleza*
- *Consecuencias*
- *Forma y métodos de medición*
- *Medidas remediales*

Especificación del Modelo

- *Concepto de especificación*
- *Tipos de errores de especificación*
- *Consecuencias de los errores de especificación*
- *Pruebas de errores de especificación*

Modelos Autorregresivos y de Rezagos Distribuidos

- *El papel del tiempo y de los rezagos en la economía*
- *Modelos alternativos de rezagos distribuidos*
- *Estimación de modelos autorregresivos*
- *Métodos de variables instrumentales*
- *Otros*

Modelos con Variables Cualitativas

- *Naturaleza de las variables cualitativas o binarias*
- *Regresión con variables independientes cualitativas y cuantitativas*

Series de Tiempo

- *Definiciones y conceptos*
- *Estacionariedad, estacionalidad e invertibilidad*
- *Estimación de modelos*

Modelos de Ecuaciones Simultáneas

- *Conceptos y definiciones*
- *Modelos y estimación*
- *Ejemplos*
- *Otros*

MATERIAL DE CONSULTA

- Berenson Mark; Levine David; Goldstein Mathew. 1987. Intermediate Statistical Methods and Application. A Computer Package Approach. Prentice - Hall*
- Gujarati, Damodar. 1990. Econometría. McGraw-Hill, 2a. edición*
- Green William. 1991. Econometric Analysis. Macmillan Publishing Company*
- Judge, George; Carter, Hill; Griffiths, William. 1982. Introduction to the Theory and Practice of Econometrics. John Willey & Sons. New York*
- Johnston, J. 1984. Econometric Methods*
- Kmenta, Jan. 1986. Elementos de Econometría. Vicens Universidad*
- Kennedy, Peter. 1991. A Guide to Econometrics. The MIT Press*
- Larson Harold. 1986. Introduction to Probability Theory and Statistical Inference. John Willey & Sons. New York*
- Maddala, G. S. 1985. Econometría. McGraw-Hill*
- Mendenhall, William. 1986. Introduction to Probability and Statistics. Duxbury Press*
- Manual de SAS. Última versión*
- Manual de TSP. Última versión*
- Mendenhall William. Introducción al Muestreo. Publishing Company, Inc., Belmont, California. 1978*
- Neter, John; Wasserman, William; Kutner, Michael. 1986. Applied Linear Regression Models. Richard Irwin Inc.*
- Novalés, Alfonso. 1993. Econometría. McGraw-Hill, segunda edición*
- Pindyck, R.; Rubinfeld, D. 1981. Econometric Models and Econometric Forecasts. McGraw-Hill*