

PROGRAMA DE ECONOMETRIA

Profesor: Alvaro Montenegro García
Segundo Semestre de 1996

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

1. Repaso de conceptos estadísticos -
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. Modelos con variables limitadas
 - (a) variables dummy
 - (b) ~~l~~ógit, próbit
 - (c) censuradas, truncadas
5. Errores en variables
6. Ecuaciones simultáneas
7. Tópicos en series de tiempo
 - (a) características de las series de tiempo
 - (b) algunos modelos, ARMA, VAR
 - (c) predicción
 - (d) causalidad
 - (e) cointegración
 - (f) otros temas, caos, análisis espectral

maximización
de la utilidad
y optimización
numérica

Algunos textos sugeridos pero no requeridos son: (ojalá ediciones recientes).

Greene, W. Econometric Analysis.

Gujarati, D. Econometría.

Johnston, J. Econometric Methods.

Judge, G. et al. Introduction to the Theory and Practice of Econometrics.

Kennedy, P. A Guide to Econometrics.

La nota final se computará de dos exámenes (33.3% cada uno) y del resultado de los talleres (33.3%). La máxima nota de las tareas se deprecia linealmente con cada día hábil de atraso en su entrega.