

1

UNIVERSIDAD DE LOS ANDES
FACULTAD DE ECONOMÍA
Programa Econometría II - 1999 II

Profesor: Luis Fernando Melo

Teléfono: 3430398

Profesora Asistente : Rocio Betancurt

E-mail: lmelove@banrep.gov.co

E-mail: yrociobg@hotmail.com

I. Repaso del modelo lineal general

II. Ecuaciones Simultáneas

A. Especificación e Identificación en Modelos de Ecuaciones Simultáneas

Modelo de ecuaciones simultáneas y supuestos

Consecuencias de la estimación MCO sobre los parámetros de las ecuaciones estructurales

Ecuaciones de forma reducida y su estimación

Identificación:

Condición de Orden

Condición de Rango

B. Estimación e Inferencia en Sistemas de Ecuaciones Simultáneas

Métodos tradicionales de estimación:

Ecuación simple o métodos de información limitada

Minimos Cuadrados Indirectos

Mínimos Cuadrados en Dos Etapas

Sistemas o métodos de Información Completa

Mínimos Cuadrados en Tres Etapas

III. Ecuaciones de Regresión Aparentemente no Relacionadas

Especificación general del modelo

Estimación con matriz de varianza conocida

Estimación con matriz de varianza no conocida

Prueba sobre existencia de correlación contemporánea

Restricciones lineales sobre los coeficientes

IV. Series de tiempo

A. Introducción a series de tiempo

Definición de una serie de tiempo

Procesos Estacionarios

Bibliografía.

Econometría.

- Judge, G.G. et al. *Introduction to the Theory and Practice of Econometrics*. Second edition, John Wiley & Sons, 1988.
- Judge et al. *The Theory and Practice of Econometrics*. Wiley, Second Edition, 1985.
- Novales, Alfonso. *Econometría*. Segunda edición, McGraw-Hill, 1993.
- Greene, W.H. *Econometric Analysis*. Second Edition, Macmillan, 1990.
- Kennedy, Peter. *A guide to Econometrics*. Third edition, The MIT Press, 1992.
- Maddala, G.S. *Introduction to Econometrics*. Second edition, Macmillan Publishing Company, 1988.
- Pindyck, R. & Rubinfeld, D. *Econometric Models & Economic Forecasts*. Third edition, McGraw-Hill International editions, 1991.

Series de Tiempo.

- Chatfield, C. *The Analysis of Time Series, An Introduction*. Fourth edition, Chapman & Hall, 1992.
- Guerrero, V. *Análisis Estadístico de Series de Tiempo Económicas*. Universidad Autónoma Metropolitana, México, 1991.
- Hamilton, J.D. *Time Series Analysis*. Princeton University press, 1994.
- Wei, William. *Time Series Analysis: Univariate and Multivariate Methods*. Addison-Wesley, 1990.

Sistema de evaluación:

Dos parciales:	45%
Tareas y Quices:	25%
Examen final:	30%

Aproximaciones a la nota definitiva del curso:

2.86 - 3.259:	3.0
3.26 - 3.859:	3.5
3.86 - 4.399:	4.0
4.40 - 4.859:	4.5
4.86 - 5.000:	5.0

Bibliografía.

Econometría.

- Judge, G.G. et al. *Introduction to the Theory and Practice of Econometrics*. Second edition, John Wiley & Sons, 1988.
- Judge et al.. *The Theory and Practice of Econometrics*. Wiley, Second Edition, 1985.
- Novales, Alfonso. *Econometría*. Segunda edición, McGraw-Hill, 1993.
- Greene, W.H. *Econometric Analysis*. Second Edition, Macmillan, 1990.
- Kennedy, Peter. *A guide to Econometrics*. Third edition, The MIT Press, 1992.
- Maddala, G.S. *Introduction to Econometrics*. Second edition, Macmillan Publishing Company, 1988.
- Pindyck, R. & Rubinfeld, D. *Econometric Models & Economic Forecasts*. Third edition, McGraw-Hill International editions, 1991.

Series de Tiempo.

- Chatfield, C. *The Analysis of Time Series, An Introduction*. Fourth edition, Chapman & Hall, 1992.
- Guerrero, V. *Análisis Estadístico de Series de Tiempo Económicas*. Universidad Autónoma Metropolitana, México, 1991.
- Hamilton, J.D. *Time Series Analysis*. Princeton University press, 1994.
- Wei, William. *Time Series Analysis: Univariate and Multivariate Methods*. Addison-Wesley, 1990.

Sistema de evaluación:

Dos parciales:	45%
Tareas y Quices:	25%
Examen final:	30%

Aproximaciones a la nota definitiva del curso:

2.86 - 3.259:	3.0
3.26 - 3.859:	3.5
3.86 - 4.399:	4.0
4.40 - 4.859:	4.5
4.86 - 5.000:	5.0