

04/5.5.

UNIVERSIDAD DE LOS ANDES
FACULTAD DE ECONOMÍA
Programa Econometría II - 2000 I

Profesor: Luis Fernando Melo

Teléfono: 3430398

Profesor Asistente : Wilson Mayorga

E-mail: lmelove@banrep.gov.co

E-mail: wmayorga@latinmail.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. Modelos Logit y probit

Notación

Estimación e Inferencia

Pruebas de hipótesis

Medidas de bondad de ajuste

IV. 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

V. Series de tiempo

A. Introducción a series de tiempo

Definición de una serie de tiempo
Procesos Estacionarios
Procesos Ruido Blanco
Transformaciones para obtener estacionariedad

B. Modelos ARIMA

Metodología de Box-Jenkins
Modelos AR, MA, ARMA y ARIMA
Funciones de autocorrelación (ACF) y de autocorrelación parcial (PACF)
ACF y PACF muestrales
Identificación de modelos ARIMA
Estimación de modelos ARIMA
Diagnóstico y Pronóstico de modelos ARIMA
Modelos ARIMA con estacionalidad

C. Modelos ARIMA con Intervención

VI. Modelos de Series de Tiempo y Corte Transversal (OPCIONAL)

Modelos con todos los coeficientes constantes
Modelos con intercepto cambiante a través de los individuos
 Modelo de variable dummy
Modelo de componente de error
Modelos con intercepto cambiante a través de los individuos y del tiempo
 Modelo de variable dummy
Modelo de componente de error
Modelos con coeficientes que cambian a través de los individuos
 Modelo de coeficientes aleatorios de Swamy
Modelos con coeficientes que cambian a través de los individuos y el tiempo

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*. Fourth Edition, Prentice Hall, 1999.
- Kennedy, Peter. *A guide to Econometrics*. Fourth edition, The MIT Press, 1998.
- Maddala, G.S. *Introduction to Econometrics*. Second edition, Macmillan Publishing Company, 1992.
- Pindyck, R. & Rubinfeld, D. *Econometric Models & Economic Forecasts*. Fourth edition, McGraw-Hill International editions, 1997.

Series de Tiempo.

- Chatfield, C. *The Analysis of Time Series, An Introduction*. 5th edition, Chapman & Hall, 1996.
- Guerrero, V. *Análisis Estadístico de Series de Tiempo Económicas*. Universidad Autónoma Metropolitana, México, 1991.
- Hamilton, J.D. *Time Series Analysis*. Princeton University press, 1994.
- Vandaele, Walter. *Applied Time Series and Box-Jenkins Models*. Academic press, 1983.
- 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