

1

04/5

UNIVERSIDAD DE LOS ANDES
FACULTAD DE ECONOMÍA

ECONOMETRÍA 2

Primer Semestre de 2001
Profesor: Roberto Ayala

OBJETIVOS

El objetivo del curso es familiarizar al estudiante con las principales herramientas econométricas que son necesarias para el manejo de datos, la aplicación y validación empírica de las teorías económicas. En particular, el curso se divide en dos partes: la primera, en la que se tratarán temas relacionados con macroeconometría (temas 1 a 5) y la segunda, en la que se presentarán técnicas más directamente utilizadas en aplicaciones de microeconomía (temas 6 y 7). De esta manera, se espera que luego de este curso el estudiante aprenda a manejar técnicas que le permitirán analizar de manera más rigurosa la información económica, verificar hipótesis y realizar predicciones.

METODOLOGÍA

La metodología a utilizar durante el curso será la presentación de la materia por parte del profesor, involucrando para ello la participación activa de los estudiantes en el análisis y desarrollo de los temas. El curso se complementa con tareas asignadas para cada tema, así como con las clases de taller que serán dictadas por el profesor auxiliar y en las que los estudiantes se familiarizarán con paquetes estadísticos como aquellos incorporados en *Econometric Views* y Gauss.

BIBLIOGRAFÍA

Greene, William H. (1997). "Econometric Analysis". Third Edition. Prentice Hall. (GR)
Gujarati, Damodar (1997). "Econometría". Tercera Edición. McGraw-Hill. (G)
Johnston, Jack y Dinardo, John (1997). "Econometric Methods". Fourth Edition. McGraw-Hill. (JD)
Judge, George et al (1988). "Introduction to the Theory and Practice of Econometrics". Wiley. (J)

PROGRAMA

1. Modelos de Ecuaciones Simultáneas.

(*) G. Caps. 18, 19, 20.

(*) J. Caps. 14, 15.

GR. Cap. 16.

2. Estacionariedad, raíces unitarias y cointegración.

(*) G. Cap. 21.

(*) JD. Cap. 7.

GR. Cap. 18.

3. Enfoque de Box-Jenkins: modelos ARIMA.

(*) G. Cap. 22.

(*) JD. Cap. 7.

J. Cap. 16.

GR. Cap. 18.

4. Vectores Autorregresivos.

(*) G. Cap. 22.

(*) JD. Cap. 9

J. Cap. 18.

GR. Cap. 17.

5. Econometría Dinámica: Modelos Autorregresivos y de Rezagos Distribuidos.

(*) G. Cap. 17.

(*) JD. Cap. 8.

J. Cap. 17.

GR. Cap. 17.

6. Variables Dependientes con Dominio Limitado.

(*) G. Cap. 15, 16.

(*) JD. Cap. 13.

GR. Cap. 19, 20.

7. Datos de Panel.

(*) G. Cap. 11.

(*) JD. Cap. 12

J. Cap. 19.

GR. Cap. 14.

(*): lectura obligatoria.

EVALUACIÓN

La puntuación final de cada parcial estará ponderada de la siguiente manera:

Tareas	15%
Parciales:	50%
Examen Final:	35%

Se tomarán tres exámenes parciales, aunque para la ponderación final se elegirán dos de las mejores notas obtenidas. Las fechas probables de los exámenes parciales son:

Parcial 1	Viernes 16 de febrero
Parcial 2	Viernes 16 de marzo
Parcial 3	Viernes 27 de abril

El sistema de aproximación de la nota final se hará de la siguiente manera:

Notas Finales con cifras decimales comprendidas entre:		Aproximación
0,000	0,249	0-
0,250	0,499	0,5
0,500	0,749	0,5
0,750	0,999	0+

Sin embargo, la nota necesaria para aprobar el curso deberá ser por lo menos 3,000. De esta manera, la aproximación para la nota final descrita anteriormente no será válida para las calificaciones comprendidas entre 2,75 y 2,999.