

UNIVERSIDAD DE LOS ANDES
FACULTAD DE ECONOMIA
PROGRAMA DE ECONOMETRIA II
II SEMESTRE DEL 2001

Profesores: Luis Jorge Ferro
Liliana Garrido

Fecha	
Agosto	
Mi 8	Introducción
Vi 10	Repaso del modelo lineal General
Lu 13/ Mi 15	Modelo de Ecuaciones Simultáneas. Introducción. Notación
Vi 17	Continuación, ejercicios
Mi 22	El problema de indentificación
Vi 24	Continuación, ejercicios
Lu 27/ Mi 29	Métodos de estimación
Vi 31	Continuación, ejercicios

Septiembre	
Lu 3/ Mi 5	Repaso
Vi 7	Parcial 1
Lu 10/ Mi 12	Modelo Probit
Vi 14	Continuación, ejercicios
Lu 17/ Mi 19	Modelos Logit
Vi 21	Continuación ejercicios
Lu 24/ Mi 26	Modelos SURE
Vi 28	Repaso. Parcial 2

Octubre	
Receso. Octubre 1-5	
Lu 8/ Mi 10	Modelos de Series de Tiempo. Procesos Estocásticos
estacionarios	
Vi 12	Continuación, ejercicios
Mi 17	Procesos integrados y Diferenciación, Caminatas
Aleatorias, Regresión Espúrea	
Vi 19	Continuación, ejercicios
Lu 22/ Mi 24	Raíces Unitarias, Cointegración, Modelo GARCH
Vi 26	Continuación, ejercicios
Lu 29/ Mi 31	propiedades de os Modelos Dinámicos

Noviembre	
Vi 2	Continuación, ejercicios
Mi 7	Repaso
Vi 9	Parcial
Mi 14	Modelos de Series de Tiempo y Corte Transversal
Vi 16	Continuación ejercicios
Lu 19/ Mi 21	Modelos con coeficientes que varían a lo largo del tiempo y
transversalmente	
Vi 23	Continuación, ejercicios

EXÁMENES FINALES: Nov. 26 – Dic. 10

2
EVALUACIÓN DEL CURSO: 3 parciales: 50%, examen final: 25%. Tareas: 25%

BIBLIOGRAFIA

- Judge, Griffiths W. Et. al Introduction to the theory and Practice of Econometrics. Second edition, John Wiley & Sons, 1988
Judge, Griffiths W. Et. al The Theory and Practice of Econometrics. Wiley, Second Edition, 1985
Judge, Griffiths Hill. Learning and Practicing Econometrics. Wiley, 1993
Greene. Econometric Analysis. Fourth Edition, Prentice Hall, 1999
Novales Alfonso. Econometría, Segunda Edición, McGraw-Hill, 1993
Maddala. Introducción a la Econometría, Prentice Hall. Segunda Edición, 1996
Gujarati. Basic Econometrics. Third Edition. McGraw- Hill
Harvey. The Econometric Analysis of Time Series. Second Edition. Philip Allan
Biernes. Topics in Advanced Econometrics. Cambridge University Press