

Objetivo: Familiarizar al estudiante con otros métodos importantes en el análisis econométrico.

Metodología: En lo posible para cada tema hay una clase magistral y otra de ejercicios.

Los ejercicios se asignarán el día de la clase magistral y la idea es que los estudiantes los puedan trabajar antes de la clase de ejercicios. Se usará como texto guía el de Greene y como lectura obligatoria el de Gujarati. El libro de Greene tiene una buena introducción formal a los temas tratados, y el libro de Gujarati tiene buenos ejemplos y ejercicios económicos relacionados. Los ejercicios se sacarán de los textos y de los libros en la bibliografía.

Prof: Liliana Garrido

Textos: Greene. Econometric Analysis, Fourth Edition, Prentice Hall, 1999

Gujarati. Basic Econometrics, Third Edition, McGraw-Hill

Contenido

Fecha	Contenido
Enero	
Ma 03	Repaso
Lu 20	Datos Panel. Cap. 14 Greene. Efectos fijos
Ma 21	Continuación, ejercicios
Mi 22	continuación
Lu 27	Efectos aleatorios
Ma 28	continuación, ejercicios
Mi 29	continuación
Febrero	
Lu 03	Sistemas de Ecuaciones de Regresión. Cap. 15
Ma 04	continuación
Mi 05	continuación
Lu 10	ejercicios: 1,5,3,7,8
Ma 11	continuación
Mi 12	Parcial 1
Lu 17	Modelos de Series de Tiempo. Cap. 18
Ma 18	Procesos estacionarios, ejercicios
Mi 19	Procesos integrados y diferenciación, caminatas aleatorias
Lu 24	raíces unitarias, cointegración
Ma 25	ejercicios
Mi 26	Modelos Garch
Marzo	
Lu 03	continuación
Ma 04	ejercicios
Mi 05	Parcial 2
Lu 10	Modelos de regresión dinámicos
Ma 11	continuación
Mi 12	continuación
Lu 17	VAR
Ma 18	continuación
Mi 19	ejercicios
Lu 24	festivo
Ma 25	Modelos de Ecuaciones Simultáneas. Cap. 16
Mi 26	Identificación
Lu 31	continuación
Abril	
Ma 01	ejercicios 1,2,3,5
Mi 02	métodos de estimación
Lu 07	continuación

Ma 08 ejercicios: 6
 Mi 09 Pruebas de especificación, repaso
 Semana Santa
 Lu 21 Modelos con variables dependientes discretas
 Ma 22 Modelos Probit y Logit
 Mi 23 Parcial 3
 Lu 28 estimación e inferencia
 Ma 29 ejercicios: 1,3,6
 Mi 30 continuación

Exámenes finales: Lun Mayo 05 a Sab 17 2003

Porcentaje de las evaluaciones: 3 parciales 20% cada uno, tareas 20%, examen final 20%.

Forma de aproximación final: $A.25 \leq \text{nota} < A.75$ se aproxima a A.5, $A.75 \leq \text{nota} < A.25$ se aproxima a A; esto si $\text{nota} \geq 1.5$. Si $\text{nota} < 1.5$ se aproxima a 1.5

BIBLIOGRAFÍA.

- 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.
 Bierens. Topics in Advanced Econometrics. Cambridge University Press.
 Enders Walter. Applied Econometric Time Series. Wiley, 1995
 Johnston, Dinardo. Econometric Methods, Fourth Edition, McGraw-Hill, 1997