

UNIVERSIDAD DE LOS ANDES
FACULTAD DE CIENCIAS ECONÓMICAS Y SOCIALES (FACES)
MAESTRÍA EN ECONOMÍA.

PROGRAMA DE LA ASIGNATURA
ECONOMETRIA

Unidades Crédito: tres (3)

Profesor Responsable: Francisco Belandria

OBJETIVO GENERAL:

Capacitar al estudiante en el uso de la econometría como herramienta fundamental, para el análisis, seguimiento y evaluación de los datos económicos como pieza fundamental para el estudio de la teoría económica.

Objetivos Específicos

- 1- Conocer, manejar y aplicar los conceptos básicos de Econometría.
- 2- Ser capaz de leer y entender un artículo econométrico básico.
- 3- Ser capaz de elaborar un artículo econométrico.

CONTENIDO PROGRAMÁTICO:

1- El modelo Econométrico.

- La perturbación aleatoria. Significado e importancia
-

2-Supuestos del Modelo Clásico de Regresión Lineal Normal.

3-Modelo Clásico en Notación matricial. Estimadores. Propiedades.

- Estimación.

4-Multicolinealidad. Definición. Detección. Consecuencias. Remedio.

5-Heterocedasticidad. Definición. Detección. Consecuencias. Remedio.

6-Autocorrelación.

- Definición. Detección. Consecuencias. Modelos AR, MA, ARMA, ARCH, GARCH. Remedio.
-

7-VARIABLES DICÓTOMAS.

8-Predicción.

9-Estacionariedad, Raíces Unitarias, Cointegración.

10-Modelo de Ecuaciones simultáneas. Naturaleza. Identificación. Mínimos cuadrados en dos etapas

ESTRATEGIAS DE EVALUACIÓN

- 1- Exámenes 60%.
- 2- Artículo Econométrico 40%

BIBLIOGRAFÍA

Gujarati, Damodar, *econometría Básica*, McGraw-Hill, tercera edición.
Goldberger, Arthur, *Teoría Econométrica*, editorial Tecnos, S.A, 1970.