

**PROGRAMA ANALÍTICO**

Carrera: ECONOMÍA

Programa de: **ECONOMETRÍA II**

Código SIS: 1304036

Nivel: Sexto Semestre

N° Hrs. De clases Teóricas: 4

N° Hrs. De clases Prácticas: 2

**Prerrequisitos:**

- 1) Macroeconomía II
- 2) Econometría I
- 3)
- 4)

**AREAS DE COORDINACION CURRICULAR**

**VERTICAL**

**HORIZONTAL**

- 1) Microeconomía I y II
- 2) Macroeconomía I y II
- 3) Estadística I y II

- 1) Políticas Macroeconómicas
- 2) Desarrollo Económico II
- 3) Economía Internacional II

**Objetivos:**

- Formular y especificar modelos adecuados que representen relaciones simples y multiecuacionales sencillos entre variables económicas que representan una o más teorías económicas no complejas.
- Utilizar los métodos estadísticos adecuados a cada caso particular de los diferentes problemas econométricos, así como interpretar los resultados estadísticos en función de la teoría económica que trata.

**Contenidos Mínimos:**

1. **Problemas Econométricos: Autocorrelacion y Heteroscedasticidad.**
  - 1.1. Naturaleza de la Autocorrelación y sus consecuencias.
  - 1.2. Test de Autocorrelación.
  - 1.3. Soluciones posibles a la Autocorrelación.
  - 1.4. Naturaleza de la Heteroscedasticidad y sus consecuencias.
  - 1.5. Test de Heteroscedasticidad.
  - 1.6. Soluciones al problema de heteroscedasticidad.
2. **Variables Dicotómicas.**
  - 2.1. Naturaleza de las variables dicotómicas.
  - 2.2. Regresión con variables dicotómicas.
  - 2.3. Interacción de variables.
  - 2.4. Modelos con variables dicotómicas dependientes.
  - 2.5. Modelo Lógit.
  - 2.6. Modelo Probit.
3. **Modelos con Retardos y Series Temporales.**
  - 3.1. Naturaleza de los modelos con variables retardadas.
  - 3.2. Modelos de retardos distribuidos. Métodos de estimación.
  - 3.3. Modelos de ajuste parcial, de expectativas y autorregresivos.
  - 3.4. Tendencia y estacionalidad.
  - 3.5. Verificación de modelos ARIMA.
4. **Modelos Multiecuacionales e Identificación.**
  - 4.1. Naturaleza de los modelos multiecuacionales.
  - 4.2. Mínimos cuadrados indirectos, en dos etapas y razón mínima de

|                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|----------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                      | <p><b>varianzas.</b></p> <p><b>4.3. Naturaleza del problema de Identificación.</b></p> <p><b>4.4. Identificación con restricciones lineales.</b></p> <p><b>4.5. Identificación por condiciones de orden (necesaria) y rango (suficiente).</b></p> <p><b>5. Métodos Bayesianos en Econometría.</b></p> <p><b>5.1. Naturaleza del método básico Bayesiano.</b></p> <p><b>5.2. Teoría estadística de la decisión y método Bayesiano.</b></p> <p><b>5.3. Funciones de pérdida y funciones de riesgo.</b></p> <p><b>5.4. Análisis Bayesiano de modelos de regresión simple.</b></p> <p><b>5.5. Caso de distribuciones a priori difusas.</b></p>                                                                                                                             |
| <b>Bibliografía:</b> | <ol style="list-style-type: none"> <li>1) GUJARATI, Damodar N. "Econometría" Tercera Edición. Bogotá, Buenos Aires, etc., MC.GRAW – HILL.</li> <li>2) MADDALA G.S. "Introducción a la Econometría" Segunda Edición. México, Bogotá, etc.</li> <li>3) PINDYCK Robert y RUBINFELD Daniel L. "Econometría, Modelos y Pronósticos", Cuarta Edición. México, Buenos Aires, caracas, etc., Mc. Graw – Hill.</li> <li>4) AZNAR Grasa A. y GARCIA Ferrer A. "Problemas de Econometría". PIRAMIDE.</li> <li>5) FREUD, John E. WILLIAMS, Frank J. PERLES, Benjamin M. "Estadística para la Administración" México, Rio de Janeiro. Prentice Hall S.A.</li> <li>6) MADDALA G.S. "Econometría". Madrid, Bogotá, Buenos Aires, México, etc., Mc.Graw-Hill. Pág. 52 – 61.</li> </ol> |