



CONTENIDO ANALÍTICO

[1] IDENTIFICACIÓN

ASIGNATURA:	ECONOMETRÍA I	SIGLA:	C-115
ÁREA CURRICULAR:	CUANTITATIVAS	CICLO:	PROFESIONAL
MODALIDAD:	SEMESTRAL	NIVEL:	QUINTO SEMESTRE
PRE-REQUISITO:	C-114		

[2] OBJETIVO

Dotar de instrumentos de análisis, a través de métodos y técnicas de contrastación empírica, para explicar el funcionamiento de procesos, modelos y fenómenos relacionados a la economía y evaluar y aplicar modelos econométricos aplicados a series de tiempo y sección cruzada.

[3] CONTENIDO

1. Modelos de regresión Lineal

- 1.1 Definición de Econometría
- 1.2 Elementos para la especificación de modelos econométricos
- 1.3 Forma estructural, forma reducida y forma final de modelos econométricos
- 1.4 Regresión múltiple, justificación y descripción del modelo
- 1.5 Métodos de estimación
- 1.6 Formulación e interpretación de los resultados de un modelo de regresión múltiple
- 1.7 Verificación de hipótesis e intervalos de confianza para los parámetros
- 1.8 Bondad de ajuste e interpretación del modelo
- 1.9 Predicción

2. Problemas econométricos

- 2.1 Multicolinealidad
- 2.2 Heterocedasticidad
- 2.3 Autocorrelación
- 2.4 Normalidad
- 2.5 Estabilidad del modelo
- 2.6 Problemas de especificación: omisión de variables relevantes e inclusión de variables irrelevantes
- 2.7 Correlación entre los regresores y el término de error: test de Hausman, estimación por variables instrumentales, test de Sargan

3. Regresión con variables cualitativas

- 3.1 Variables ficticias en el modelo de regresión
- 3.2 Interpretación de los efectos de las variables explicativas ficticias - tipos de modelos
- 3.3 Prueba de estabilidad estructural de modelos de regresión
- 3.4 Usos de las variables ficticias

4. Tópicos en modelos univariados

- 4.1 Modelos de rezagos distribuidos
- 4.2 Modelos con distribución infinita de retardos
- 4.3 Modelos de ajuste parcial
- 4.4 Tests para causalidad de Granger

5. Ecuaciones simultaneas

- 5.1 El problema de la identificación



- 5.2 Estimación consistente de parámetros
- 5.3 Mínimos Cuadrados en Dos Etapas
- 5.4 Estimación de ecuación simultánea con correlación serial y variables dependientes rezagadas
- 5.5 Métodos de estimación más avanzados

[4] BIBLIOGRAFÍA

- Greene, William H., "Análisis Econométrico"
- Novales, A., "Econometría"
- Gujarati, D. N., "Econometría"
- Pindyck R. y Rubinfeld, Daniel, "Econometría: Modelos y pronósticos"
- Maddala, G. S., "Introducción a la Econometría"
- Kennedy, Peter, "A Guide to Econometrics"

