



Universidad Simón Bolívar

DIVISION	FISICA Y MATEMATICAS		
DEPARTAMENTO:	COMPUTO CIENTIFICO Y ESTADISTICA		
ASIGNATURA:	CO7311 ECONOMETRIA		
HORAS/SEMANA:	TEORIA 0	LABORATORIO 0	PRACTICA 0
VIGENCIA:	ABRIL 2005		
REQUISITOS:			

PROGRAMA

1.- Modelo de Regresión Estático:

1.1.- El modelo de Regresión Simple. Importancia de la Regresión en la Econometría. Estimación por Mínimos Cuadrados y Máxima Verosimilitud. Propiedades de los Estimadores. Test de Hipótesis

1.2.- El modelo de Regresión Simple. Estimación Bayesiana. Cálculo de propiedades de los estimadores. Test de Hipótesis por los Factores de Bayes.

1.3.- El modelo de Regresión Múltiple. Estimación Clásica y Bayesiana. Test de Hipótesis Clásicos y Bayesianos.

1.4.- Supuestos de la Regresión. Varianza no constante (Heterocedasticidad), Errores no-Gaussianos. Transformaciones Estabilizadoras de la Varianza. Transformaciones de Box y Cox. Funciones Generalizadas de Producción.

1.5.- Presencia de autocorrelación. Test de Durbin-Watson. Multicolinealidad. Soluciones. Los Modelos Logit y Probit. Modelos de Ecuaciones Simultáneas

1.6.- Clase práctica, con ejemplos de Regresión Simple y Múltiple, utilizando MINITAB. Envío del primer Proyecto a ser entregado.

2.- Modelos de Regresión Dinámica y Series Cronológicas

2.1.- Series cronológicas Estacionarias y No-Estacionarias. El enfoque de Box y Jenkins. Modelos AR, MA y ARMA.

2.2.- Introducción a los modelos Dinámico Lineales. Relación con los modelos estáticos. Predicción. Monitoreo del Modelo

2.3.- Modelo de Regresión Dinámica Bayesiano. Modelo de Crecimiento Constante. Modelo de Crecimiento Lineal. Predicción a un paso.

2.4.- Análisis de Intervención. Componentes de crecimiento Polinomial. Descuento de la información para modelizar períodos de cambio. Aprendizaje sobre la tendencia y la varianza.

BIBLIOGRAFIA

Maddala, G. S. (1996) "Introducción a la Econometría". (Segunda Edición). Prentice-Hall. Hispanoamericana S.A.-

Pole, A. West, M. and Harrison, J. (1994) "Applied Bayesian Forecasting and Time Series Analysis", Chapman and Hall.-