|  |
| --- |
| **VII SEMESTRE** |
| ***Descripción General:*** |
| Asignatura : Econometría  Año : 4to Año  Horas : 4-0-0  Requisitos : Estadística Empresarial |
| ***Objetivos Generales:*** |
| * Entregar una base sólida en la teoría y práctica de la estimación econométrica de modelos uni ecuacionales y una introducción a los modelos multiecuacionales. |
| ***Contenido Unidades Temáticas:*** |
| *UNIDAD 1 ANÁLISIS ESTADÍSTICO EN ECONOMÍA Y CARACTERÍSTICAS DEL ANÁLISIS*  *ECONOMÉTRICO**UNIDAD 2 CURVAS DE REGRESIÓN Y MÉTODO DE LOS MÍNIMOS CUADRADOS*  * 1. Análisis estadístico de dos o más variables.   2. Concepto y propiedades de una curva de regresión.   3. Curva mínima cuadrática (MICO) de “n” variables.   4. Calculo de R.   5. Expresión matricial del modelo MICO.  *UNIDAD 3 MODELO DE REGRESIÓN MULTIPLE (MRM)*  * 1. Estimadores estadísticos: definición y propiedades.   2. MRM como modelo probabilístico.   3. Estimadores MICO del MRM.   4. Teorema de Gauss Markov.  *UNIDAD 4 LOS ESTIMADORES MICO CONSIDERADOS COMO VARIABLES ALEATORIAS:*  *INFERENCIA Y TEST DE HIPÓTESIS EN EL MRM.*  * 1. Modelo normal (principales distribuidores de probabilidad).   2. Distribuidores de probabilidad de los estimadores MICO.   3. Intervalos de confianza y test de hipótesis de coeficientes individuales.   4. Test para combinaciones lineales de coeficiente de regresión.   5. Test para un sub-conjunto de coeficiente de regresión.   6. Test para el total de vector de coeficientes.   7. Test de hipótesis para la varianza de los errores.   8. Intervalos de confianza para un conjunto de coeficientes de regresión.   9. Predicciones en el MRM.   10. Test de hipótesis usando estimación por máxima verosimilitud.   11. Aplicaciones.  *UNIDAD 5 VIOLACIÓN DE LOS SUPUESTOS DEL MODELO CLÁSICO MRM*  * 1. Multicolinealidad.   2. Error de especificación.   3. Heteroscedasticidad.   4. Auto correlación.  *UNIDAD 6 TÓPICOS ESPECIALES DEL MODELO LINEAS MRM*  * 1. Variables mudas.   2. Regresores estocásticos.   3. Modelos auto regresivos y de rezagos distribuidos.  *UNIDAD 7 OTROS TEMAS*  * 1. Errores en las variables.   2. Test de estabilidad de un modelo.   3. Estimación no lineal.   4. Ecuaciones simultáneas (principios). |
| ***Bibliografía de Referencia:*** |
| * G. S, Maddala; Introducción a la Econometría, McGraw-Hill, 1997. * Guajarati, Damodar; Econometría Básica, McGraw-Hill, 1977. * Johnston; Métodos de Econometría, Vicens-Vives, 3° Edic., 1989. * Kennedy, P. A.; Guide to Econometrics, The MIT Press, Cambridge, 1992. |