



CARRERA DE ECONOMÍA



PROGRAMA ANALÍTICO ECONOMETRÍA II

1. Datos Generales

Unidad de Formación:	Econometría II	Código SISS: 1304036
Carácter:	Obligatoria	
Nivel:	Sexto Semestre	
Dependencia:	Carrera de Economía	
Carga Horaria Total Semestre:	80 Hrs.	Créditos académicos: 2
Pre-requisitos:	Macroeconomía II - (1304014) Econometría I - (1304030)	

2. Contenidos Mínimos

Unidad Didáctica 1: Problemas Econométricos: Autocorrelación y Heterocedasticidad.	Temas: <ol style="list-style-type: none">1. Naturaleza de la Autocorrelación y sus consecuencias.2. Test de Autocorrelación.3. Soluciones posibles a la Autocorrelación.4. Naturaleza de la Heterocedasticidad y sus consecuencias.5. Test de Heterocedasticidad.6. Soluciones al problema de Heterocedasticidad.
Unidad Didáctica 2: Modelos con Variables Dicotómicas.	Temas: <ol style="list-style-type: none">1. Naturaleza de las variables dicotómicas.2. Regresión con variables dicotómicas predeterminadas.3. Interacción de Variables.

	<ol style="list-style-type: none"> 4. Modelos con variables dicotómicas dependientes. 5. Modelo Lineal de Probabilidad. 6. Modelo LOGIT. 7. Modelo PROBIT. 8. Modelos Censurados, Modelos Truncados.
<p>Unidad Didáctica 3: Modelos con Retardos.</p>	<p>Temas:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Naturaleza de los modelos con variables retardadas. 2. Modelos de retardos distribuidos. Métodos de estimación. 3. Modelos de ajuste parcial, de expectativas y autorregresivos. 4. Método de Almon. 5. Método de Variables Instrumentales. 6. Causalidad a la Granger.
<p>Unidad Didáctica 4: Modelos Multiecuacionales: Identificación y Estimación.</p>	<p>Temas:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Naturaleza de los modelos multiecuacionales. 2. El problema de Identificación. 3. Identificación por condiciones de orden (necesaria) y rango (suficiente). 4. Estimación de Modelos Multiecuacionales. <ul style="list-style-type: none"> - Mínimos Cuadrados Indirectos. - Mínimos Cuadrados en dos Etapas. - Razón Mínima de Varianzas.
<p>Unidad Didáctica 5: Modelos con datos en panel.</p>	<p>Temas:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Naturaleza. 2. Estimación de modelos en panel. <ul style="list-style-type: none"> - Métodos de efectos fijos. - Métodos de efectos Aleatorios. 3. Introducción a la Evaluación de Impacto. <ul style="list-style-type: none"> - Método: Diferencia en Diferencias.

Unidad Didáctica 6: Introducción a la Econometría de Series de Tiempo.	Temas: 1. Modelos ARIMA. 2. Modelos VAR. 3. Modelos VEC.
---	--

3. Referencia Bibliográfica General de la Unidad de Formación:

- GUJARATI, Damodar N. y PORTER, Dawn C. (2010) "Econometría" Bogotá, Colombia. McGraw-Hill Latinoamericana. Quinta Edición.
- WOOLDRIGE, Jeffrey M. Introducción a la Econometría. Un enfoque moderno. CENCAGE Learning. México, 2009. Cuarta Edición.
- JOHNSTON J Y Dinardo J. (2002), traducción, Carles Murillo Fort Métodos de Econometría, Editor, Vicens Vives.
- GREENE, W. (2002) "ANALISIS ECONOMETRICO York University, Upper Saddle River, New Jersey 07458.
- AZNAR, G, A. Y García F. A. (1994) "Problemas de Econometría", PIRAMIDE
- MADDALA G. S. (1996) "Econometría", Madrid, Bogotá, Buenos Aires, México, etc, Mc Graw-Hill.