



POSTGRADO			CAMPUS
SOCIOECONOMÍA, ESTADÍSTICA E INFORMATICA ORIENTACIÓN EN ESTADÍSTICA			MONTECILLO
<i>MAESTRÍA Y DOCTORADO</i>			

CLAVE DEL CURSO	NOMBRE DEL CURSO	TIPO DE CURSO	NÚMERO DE CRÉDITOS	CUATRIMESTRE
EST-654	ECONOMETRIA	TEORÍA	3	OTOÑO

PROFESOR TITULAR	CLAVE ACADÉMICA	PROFESOR COLABORADOR	CLAVE ACADÉMICA
PROFESORES DEL PROGRAMA			

OBJETIVO GENERAL

Este curso tiene como objetivo presentar los tópicos más importantes del área de la Econometría, con ilustraciones. Está dirigido especialmente a estudiantes de la Especialidad de Postgrado en Estadística y a estudiantes avanzados de otras Especialidades del Colegio de Postgraduados.

CONTENIDO DESCRIPTIVO DEL CURSO

Modelos Lineal General. Estimación de máxima verosimilitud. Propiedades muestrales. Cota inferior de Cramer-Rao. Estimación restringida. Inferencia estadística. Propiedades asintóticas. Análisis Bayesiano en el Modelo Lineal General. Inferencia Bayesiana en el MLG con varianza de los errores conocida. Estimación puntual. Estimación empírica. Inferencia en el MLG con varianza de los errores desconocidas. Tópicos Especiales del Modelo Lineal Comunes en Economía. Modelo lineal con estructura de covarianza conocida y desconocida. Inferencia estadística. Mínimos cuadrados generalizados. Heteroscedasticidad. Autocorrelación Variables de engaño. Conjuntos de ecuaciones lineales. Regresión no lineal. Introducción a Modelos de Ecuaciones Simultáneas. Especificaciones muestrales del modelo de ecuaciones simultáneas. Sesgo de los estimadores de mínimos cuadrados. Forma reducida y estructural. Tipos de restricciones. Identificación: orden y rango. Formulación de modelos de ecuaciones simultáneas. Inferencia Estadística en Modelos de Ecuaciones Simultáneas. Mínimos cuadrados indirectos. Mínimos cuadrados en dos etapas. Mínimos cuadrados en tres etapas. Estimadores de máxima verosimilitud con información limitada y completa. Propiedades muestrales finitas y asintóticas. Forma final. Uso del modelo estimado para decisión y predicción económica.