

PROGRAMA DE POSTGRADO: SOCIOECONOMÍA, ESTADÍSTICA E INFORMÁTICA-ESTADÍSTICA  
 CURSO: ECONOMETRÍA  
 PROFESOR TITULAR: GUSTAVO RAMÍREZ VALVERDE  
 COLABORADOR (ES): \_\_\_\_\_  
 CORREO ELECTRÓNICO: \_\_\_\_\_  
 TELÉFONO: \_\_\_\_\_ EDIFICIO/PLANTA/NÚMERO \_\_\_\_\_  
 CLAVE DEL CURSO: EST-654 PRE-REQUISITOS: EST-601, EST-642 Y EST-643

TIPO DE CURSO: PERIODO:

Teórico  Primavera  
 Práctico  Verano  
 Teórico-Práctico  Otoño  
 No aplica

SE IMPARTE A : MODALIDAD:

Maestría en Ciencias  Presencial  
 Doctorado en Ciencias  No presencial  
 Maestría Tecnológica  Mixto

HORAS CLASE: CREDITOS: 3

Presenciales \_\_\_\_\_  
 Extra clase \_\_\_\_\_  
 Total \_\_\_\_\_

Nota: Un crédito equivale a 64 horas totales (presenciales y extra clases)

**OBJETIVO GENERAL DEL CURSO**

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.

CURSO: \_\_\_\_\_

PROGRAMA DE POSTGRADO: \_\_\_\_\_

HORAS ESTIMADAS	TEMAS Y SUBTEMAS	OBJETIVOS DE LOS TEMAS
	<p>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.</p> <p>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.</p> <p>Tópicos Especiales del Modelo Lineal Comunes en Economía. Modelo lineal con estructura de covarianza conocida y desconocida. Inferencia estadística.</p> <p>Mínimos cuadrados generalizados.</p> <p>Heteroscedasticidad. Autocorrelación Variables de engaño. Conjuntos de ecuaciones lineales. Regresión no lineal. Introducción a Modelos de Ecuaciones Simultáneas.</p> <p>Especificaciones muestrales del modelo de ecuaciones simultáneas. Sesgo de los estimadores de mínimos cuadrados. Forma reducida y estructural.</p> <p>Tipos de restricciones. Identificación: orden y rango.</p> <p>Formulación de modelos de ecuaciones simultáneas. Inferencia Estadística en Modelos de Ecuaciones Simultáneas.</p> <p>Mínimos cuadrados indirectos. Mínimos cuadrados en dos etapas.</p> <p>Mínimos cuadrados en tres etapas.</p> <p>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.</p>	

CURSO: \_\_\_\_\_  
PROGRAMA DE POSTGRADO: \_\_\_\_\_

---

BIBLIOGRAFÍA IMPRESA O ELECTRÓNICA (AUTOR, AÑO, TÍTULO, EDITORIAL, FECHA, EDICIÓN)

---

Judge, G. G., R. C. Hill, W. E. Griffiths, H. Liitkepohl y T. Lee (1988). Introduction to the theory and practice of econometrics. Wiley. New York. EUA.  
Maddala, G. S. (1985). Econometría. McGraw-Hill. México.  
Malinvaud, E. (1980). Statistical methods of econometrics. North-Holland Publishing Company. San Francisco, Cal. EUA.

---