



**UNIVERSIDAD EAFIT
ESCUELA DE ECONOMÍA Y FINANZAS
DEPARTAMENTO DE FINANZAS
MAESTRÍA EN FINANZAS**

ASIGNATURA	:	Nivelatorio de Econometría
CÓDIGO	:	FI0821
INTENSIDAD	:	12 horas semanales (24 totales)
MDALIDAD	:	Magistral
CRÉDITOS	:	2
HORARIO	:	lunes, miércoles y jueves de 6:00 p.m. a 10:00 p.m
FECHA DE ACTUALIZACIÓN	:	Agosto, 2019

1. JUSTIFICACIÓN DEL CURSO:

El curso constituye una parte esencial en la formación y profundización matemática y estadística de los estudiantes del Doctorado, ya que en él se presentan los principios básicos generales de la econometría de manera formal y con casos de aplicación que permiten de manera natural entender la relación entre la teoría económica y econométrica.

2. OBJETIVO GENERAL DEL CURSO:

Presentar de manera formal los fundamentos de la Econometría aportando a los estudiantes herramientas prácticas y teóricas en relación con la investigación de temas económicos y financieros

Objetivos específicos:

- Presentar de manera formal el proceso de estimación e inferencia para el modelo lineal general.
- Presentar de manera formal los fenómenos de colinealidad, heterocedasticidad, endogeneidad y autocorrelación.
- Ilustrar con datos reales los diferentes temas tratados en el curso.

3. DESCRIPCIÓN ANALÍTICA DE CONTENIDOS:

3.1. Mínimos Cuadrados Ordinarios

1. Especificación
2. Estimación OLS
3. Inferencia en el modelo lineal



Vigilada Mineducación

4. Variable omitida
5. Error de medida 2/1
6. Teorema Frish-Waugh-lovell
7. Teorema de Gauss Markov

Capítulo 3, 4 y 5. ECOMETRIC ANALYSIS. William H. Greene. SEVENTH EDITION

3.2. Mínimos Cuadrados Generalizados

1. Heteroscedasticidad
2. Autocorrelación
3. MCG, MCG Factibles

Capítulos 10, 11 y 12. ECOMETRIC ANALYSIS. William H. Greene. SEVENTH EDITION

3.3. Variable Instrumental

1. Endogeneidad
2. Mínimos cuadrados en dos etapas
3. Propiedades asintóticas
4. Error de medida, variable omitida e IV

Capítulo 5. ECOMETRIC ANALYSIS. William H. Greene. SEVENTH EDITION

4. BIBLIOGRAFÍA GENERAL:

Texto Guía: ECOMETRIC ANALYSIS. William H. Greene. SEVENTH EDITION

Econometric Theory and Methods Russell Davidson & James G. MacKinnon

Econometrics. Badi H. Baltagi. Fourth Edition

An Introduction to Classical Econometric Theory. Ruud, P. New York, NY: Oxford University

Textos de referencia para la actualización

- * Introducción a la econometría. Wooldridge.
- * Econometría. Alfonso Novales