



Departamento de Ciencias Sociales.  
Carrera de Comercio Internacional.  
Orientación del curso: Orientación en Economía Internacional.  
Tipo de curso: Teórico-Práctico.

## Objetivos de la materia

Dadas las características del curso (un solo nivel de carácter cuatrimestral) el mismo se enfocará con un carácter puramente analítico y práctico, sosteniendo, por supuesto, el debido sustento teórico.

El objetivo primordial es el de dotar a los alumnos del instrumental suficiente para ser capaces de realizar mediciones econométricas básicas, al tiempo de comprender y analizar adecuadamente los estadísticos de una salida de resultados.

El curso se estructura en dos etapas bien definidas; una primer etapa la cual se centrará en los aspectos teóricos de la materia, donde se tratará un abanico amplio de temas que brindará al alumno de los conocimientos necesarios para realizar un análisis de los resultados obtenidos o presentados de una regresión. Asimismo se presentarán una gran cantidad de conceptos necesarios para la posterior realización de las prácticas. En la segunda etapa del curso se utilizará el programa econométrico E-Views con el cual se aplicarán todos los conocimientos adquiridos con el fin de enfrentar los conceptos teóricos de la materia con el realismo de la práctica y todos sus inconvenientes.

En todos los sentidos el programa es muy ambicioso y requerirá una dedicación elevada en cuanto a las lecturas y prácticas a realizar. No se abordarán temas de última generación tales como regresiones no lineales, ni se hará uso del álgebra matricial. Pero el alumno terminará el curso con los conocimientos suficientes para comprender y proseguir profundizando en el análisis econométrico al tiempo de ser capaz de realizar mediciones econométricas básicas e interpretar sus resultados.

## PROGRAMA Y BIBLIOGRAFIA

El material bibliográfico que se utilizará a lo largo de todo el curso esta contenido en:

- Damodar N. Gujarati. Econometría. McGraw-Hill. Colombia 1999.

### Temario por Unidades.

#### Unidad 1:

- Presentación. Introducción.
- Naturaleza del análisis de regresión; algunos comentarios.
- Análisis de regresión con dos variables. Modelo de regresión con dos variables.
- Damodar N. Gujarati. Econometría. McGraw-Hill. Colombia 1999. (capítulos 1 y 2)

#### Unidad 2:



- Modelo clásico de regresión lineal: Supuestos detrás del método de mínimos cuadrados.
- Supuesto de normalidad. Modelo Clásico de Regresión Lineal (MCRLN).
- Regresión con dos variables. Estimación de intervalos y pruebas de hipótesis.
- Damodar N. Gujarati. Econometría. McGraw-Hill. Colombia 1999. (capítulos 3, 4 y 5)

### **Unidad 3:**

- Extensión del modelo de regresión lineal de dos variables.
- Análisis de regresión múltiple: Problemas de estimación.
- Análisis de regresión múltiple problemas de inferencia.
- Damodar N. Gujarati. Econometría. McGraw-Hill. Colombia 1999. (capítulos 6, 7 y 8)

### **Unidad 4:**

- Multicolinealidad y muestras pequeñas.
- Heterocedasticidad.
- Autocorrelación.
- Damodar N. Gujarati. Econometría. McGraw-Hill. Colombia 1999. (capítulos 10, 11 y 12)

### **Unidad 5:**

- Regresión con variables dicótomas.
- Modelos econométricos dinámicos: Modelos autorregresivos y de rezagos distribuidos.
- El problema de la identificación.
- Econometría de series de tiempo I. Estacionariedad, raíces unitarias y cointegración.
- Damodar N. Gujarati. Econometría. McGraw-Hill. Colombia 1999. (capítulos 15, 17, 19 y 21)

## **METODOLOGIA de EVALUACION**

Se deberá rendir un examen escrito y realizar una exposición oral. Se calificará con una nota entre 0 y 10 siendo necesario un mínimo de 4 puntos para la aprobación.

Los exámenes requerirán no solo que el alumno demuestre conocimiento teórico y aptitud para realizar los respectivos análisis de los resultados, sino también debe demostrar conocimientos en la operación del programa E-Views.