

KXX CURSO INTERNACIONAL SOBRE DESARROLLO
PLANIFICACION Y POLITICAS PUBLICAS

Organizado por el Instituto Latinoamericano
y del Caribe de Planificación Económica y
Social (ILPES) con la colaboración de la
Comisión Económica para América Latina y el
Caribe (CEPAL), el Programa de las Naciones
Unidas para el Desarrollo (PNUD) y el apoyo
financiero del Gobierno de Italia.

Santiago, 17 julio al 7 diciembre 1989

Mención en Planificación Global

ESTIMACION DE MODELOS MACROECONOMICOS

(Programa y Bibliografía)

Ricardo Martner y Graciela Moguillansky

A. Introducción

El propósito de este curso es entregar elementos básicos de modelización macroeconómica, en las distintas etapas que abarca este proceso: a) la especificación teórica y características analíticas del modelo en su conjunto y de las principales funciones que los conforman, b) etapas de la construcción empírica de los modelos, esto es la formación de la base de datos, estimación de las ecuaciones, y por último, solución y validación.

A lo largo del curso se entregarán elementos de análisis econométrico, en forma bastante sintética y aplicada a las funciones macroeconómicas. Esto supone que los alumnos han efectuado estudios de econometría previamente.

También se efectuará una introducción al uso de paquetes computacionales para estimaciones econométricas y para la solución de modelos macroeconómicos, lo que será profundizado posteriormente en los Talleres de Programación Macroeconómica.

B. Programa

1. Etapas de la construcción de un modelo macroeconómico.
 - 1.1 Especificación del modelo
 - 1.2 Base de datos
 - 1.3 Estimación. El modelo de regresión múltiple
 - 1.4 Tests estadísticos y su significado

2. Estimación de principales funciones analíticas.
 - 2.1 Función consumo
 - Ingreso permanente
 - Otros efectos
 - Un ejemplo de estimación

- 2.2 Función inversión y empleo
 - Efecto acelerador
 - Modelo de demanda de factores
 - El rol de la tasa de rentabilidad
 - Modelo de empleo de Brechling
 - Otros modelos de empleo
- 2.3 Funciones de comercio exterior
 - Importaciones
 - Exportaciones
 - a) Modelos de demanda
 - b) Modelos de oferta
- 2.4 Funciones de precios y salarios
 - Especificación del precio deseado
 - Una "maqueta" con la especificación de la relación precios-salarios
 - Estimaciones econométricas de precios y salarios
 - Un ejemplo de estimación econométrica
- 3. Estructura y solución computacional de un modelo de simulación macroeconómica
 - 3.1 Estructura de un modelo nekeynesiano
 - 3.2 Solución de un modelo de simulación en microcomputadores. El uso del LOTUS
 - 3.3 Validación de un modelo de simulación
 - 3.4 Multiplicadores

C. Bibliografía

A. Aznar Grasa (1978) - Planificación y modelos econométricos, pp. 17-88 (fotocopias).

✓ Pindick, R. y D. Rubinfeld (1980) - Modelos econométricos, Documento Auxiliar Nº 382.

- ✓ Moguillansky, G. - "Nociones básicas de econometría y modelos lineales", Documento MYT-15.
- Martner, R. y D. Titelman (1988) - "Inflación y nivel de actividad en Chile: una aplicación del modelo de corrección de errores" (fotocopias).
- Martner, R. y G. Moguillansky (1989) - "Estimación de modelos macroeconómicos" (fotocopias).
- Moguillansky, G. y M. Rodríguez (1989) - "Un modelo macroeconómico para Argentina", primera versión.
- Martner, R. y E. García (1988) - MACROBRAS: Un modelo macroeconómico para Brasil.
- Figueroa, I. y A. Gutiérrez (1989) - Paraguay: Modelo macroeconómico de compatibilización real y financiera.
- Gutiérrez, A. y E. García (1988) - NICARPLAN: Un modelo macroeconómico para Nicaragua.
- Marfán, M. (1987) - "Un modelo macrofinanciero para una economía con restricción externa", CIEPLAN, Notas Técnicas # 106.
- Eyzaguirre, N. (1989) - "Ahorro e inversión bajo restricción externa y fiscal. El caso de Chile 1982-87", mimeo.
- Jiménez, Felipe (1989) - Solución computacional de modelos macroeconómicos.

capítulo I, II
 V
 VI
 VII