

Profesor: Ramón Rosales A; rrosales@uniandes.edu.co

Horario Atención: Jueves 10 -12 AM

Profesores complementarios:

Juan Carlos Vasquez: jvasquez@uniandes.edu.co

Juan Carlos Mendoza: juan-men@uniandes.edu.co

Monitores:

Mónica Reyes: mj.reyes68@uniandes.edu.co

Allison Benson: al.benson52@uniandes.edu.co

1. INTRODUCCION

La econometría es el instrumento cuantitativo más utilizado en el análisis de las relaciones empíricas entre variables económicas. El curso presenta el marco teórico y operativo básico de los modelos y los métodos econométricos.

2. OBJETIVOS

- Proporcionar a los estudiantes las bases iniciales para el manejo de los modelos y métodos econométricos.
- Familiarizar a los estudiantes sobre la aplicación de modelos que permitan entender el comportamiento de los agentes económicos, y en la estimación de parámetros para el análisis y evaluación de medidas de política.
- Suministrar los elementos necesarios para el manejo de la información, análisis de resultados e interpretación de salidas del computador que hagan más eficiente la labor de investigación económica.

3. COMPETENCIAS A DESARROLLAR

- Tener la capacidad de análisis y síntesis.
- Desarrollar la capacidad crítica.
- Tener la capacidad de consultar fuentes de datos y organizarlos de forma analítica y simplificadora.
- Tener la capacidad de manejar herramientas computacionales y de programar.
- Asimilar, apropiar y reproducir un canon de conocimiento en economía.
- Tener habilidad para aplicar el análisis formal a la comprensión de la realidad.
- Apropiarse de los métodos de investigación empírica. Reconocer las posibilidades, diversidad y limitaciones de su aplicación.
- Reconocer el énfasis cuantitativo de la disciplina y mostrar habilidades para el manejo cuantitativo. Desarrollar la capacidad de recolectar y/o construir datos.

4. METODOLOGIA

El curso se desarrollará mediante dos sesiones de clases semanales, en las que se expondrán los conceptos teóricos, con ejemplos ilustrativos y la realización de ejercicios en clase y tareas. El curso cuenta con sesión de taller con el propósito de cimentar los conceptos teóricos mediante el manejo del instrumental analítico a través del computador. Adicionalmente, se acordaran algunos días de monitoria. En cada capítulo se interpretarán salidas de computador (EViews-STATA) relacionados con los temas vistos.

5. EVALUACIÓN

Parcial 1	25%
Parcial 2	25%
Examen Final	25%
Taller	15%
Tareas y Quices	10%

Aproximaciones:

Las aproximaciones para la nota final serán automáticas según el siguiente criterio:

- Igual o menor a 0.25, aproxima a 0.0
- Superior a 0.25 pero igual o menor a 0.75, aproxima a 0.5
- Superior a 0.75, sube a 1.0

Reclamos:

Los reclamos deben ser por escrito y se aceptan máximo hasta 8 días hábiles después de entregados los exámenes a los estudiantes.

Algunas reglas:

- Se utiliza el internet para cualquier difusión de información.
- La convivencia en el salón de clase incluye el mantener los teléfonos celulares apagados durante la sesión de clase.
- Las establecidas en el Reglamento General de Estudiantes de Pregrado.
- Las establecidas en el Reglamento General de Estudiantes de Postgrado.

6. FECHAS IMPORTANTES

- Inicio de clases: Agosto 3
- Primer parcial: Septiembre 23
- Entrega del 30%: Octubre 2
- Ultimo día para retiro: Octubre 9
- Semana de trabajo individual: Septiembre 28 – Octubre 2
- Segundo parcial: Noviembre 18
- Ultimo día de clases: Noviembre 20
- Exámenes finales: Noviembre 23 – Diciembre 7

7. CONTENIDO

CAPITULO 1. INTRODUCCION (Semana 1) (RB, Cap 1; HGJ, Cap1; GU, Cap1; WO, Cap 1; KE, Cap 1)

- 1.1 Definición de econometría
- 1.2 Etapas de la econometría
- 1.3 Modelo económico y modelo econométrico
- 1.4 Elementos de los modelos econométricos

CAPITULO 2. CORRELACION Y REGRESIÓN SIMPLE (Semanas1, 2 y 3)(RB, Caps 2 y 3; GU Caps 2 a 6; WO, Cap 2; HGJ, Caps 3 a 6)

- 2.1 Análisis de correlación y pruebas de hipótesis
- 2.2 Objetivo del análisis de regresión
- 2.3 Especificación del modelo
- 2.4 Supuestos del modelo
- 2.5 Método de estimación de mínimos cuadrados
- 2.6 Pruebas de hipótesis
- 2.7 Predicción
- 2.8 Modelos de regresión simple no lineal

CAPITULO 3. REGRESION MULTIPLE (Semanas 4, 5, 6, 7 y 8) (RB, cap 4; GU, Caps 7 y 8; WO, Caps 3 a 6; HGJ, Caps 7 y 8; GHJ, Caps 9 a 11; JGLGL, Cap 6; JD, Cap 5)

- 3.1 Expresión del modelo en forma matricial
- 3.2 Supuestos del modelo
- 3.3 Método de estimación de mínimos cuadrados ordinarios
- 3.4 Pruebas de hipótesis
- 3.5 Predicción
- 3.6 Modelos de regresión múltiple no lineal
- 3.7 Mínimos cuadrados restringidos
- 3.8 Estimación por máxima verosimilitud

SEMANA DE TRABAJO INDIVIDUAL

CAPITULO 4. MODELOS CON VARIABLES CUALITATIVAS O FICTICIAS (Semanas 9 y 10) (GU, Cap 9; WO, Cap 7; HGJ, Cap 9)

- 4.1 Naturaleza de las variables cualitativas
- 4.2 Modelos con variables independientes cualitativas
- 4.3 Cambio estructural

CAPITULO 5. MULTICOLINEALIDAD (Semana 11) (GU, Cap 10; WO, Cap 3; HGJ, Cap 8)

- 5.1 Definición
- 5.2 Naturaleza
- 5.3 Consecuencias
- 5.4 Métodos para detectar el problema
- 5.5 Métodos para corregir el problema

CAPITULO 6. HETEROSCEDASTICIDAD (Semana 12 y 13) (GU, Cap 11; WO, Cap 8; HGJ, Cap 11; JGLGL, Cap 6; JD, Cap 6)

- 6.1 Definición
- 6.2 Naturaleza
- 6.3 Consecuencias
- 6.4 Métodos para detectar el problema

- 6.5 Métodos para corregir el problema
- 6.6 Mínimos cuadrados restringidos

CAPITULO 7. AUTOCORRELACION (Semana 13 y 14) (GU, Cap 12; HGJ, Cap 12; JGLGL, Cap 6)

- 7.1 Definición
- 7.2 Naturaleza
- 7.3 Consecuencias
- 7.4 Métodos para detectar el problema
- 7.5 Métodos para corregir el problema
- 7.6 Mínimos cuadrados restringidos

CAPITULO 8. SESGO DE ESPECIFICACION Y NO NORMALIDAD DE LOS ERRORES (Semana 15) (GU, Cap 13; WO, Cap 9)

- 8.1 Sesgo de especificación
- 8.2 No normalidad de los errores

8. BIBLIOGRAFIA

Griffiths, W.E.; R.C. Hill; G. Judge. 1993. Learning and Practicing Econometrics. John Wiley and Sons. New York. **(GHJ)**

Gujarati, Damodar. 2005. Econometría. Mc Graw Hill. **(GU)**

Kennedy, P. 1998. A Guide to Econometrics. MIT Press. **(KE)**

Hill R. Carter; W. E. Griffiths and G. Judge. 2001. Undergraduate Econometrics. 2ed. Johnson Wiley and Sons. New York. **(HGJ)**

Judge, G; W, Griffiths; H, Lutkepohl; R, Carter; T, Lee. 1998. Introduction to the Theory and Practice of Econometrics. **(JGLCL)**

Johnston, J and J. Dinardo. 1997. Econometrics Methods. Mc Graw Hill. **(JD)**

Rosales Ramón y Bonilla Jorge. 2006. Introducción a la Econometría. Apuntes de Clase No. 3. CEDE. Facultad de Economía. Universidad de los Andes. **(RB)**

Wooldridge, Jeffrey M. 2000. Introducción a la Econometría. Thomson Learning. **(WO)**