

Profesor:

Jorge Alexander Bonilla Londoño

Oficina: C 311

Profesores Asistentes:

Camilo Bohórquez Penuela:

c-bohorq@uniandes.edu.co

Jorge Andrés Perdomo:

jor-perd@uniandes.edu.co

Juliana Helo

ju-helo@uniandes.edu.co

Monitores:

Maria Jose Vargas Mancera

jose-va@uniandes.edu.co

Horario: lunes y miércoles: 10:00 – 11:20 AM., Salón ML_617. Jueves 10:00 – 11:20 AM. (Sala de computadores por definir)

Horario de atención: lunes 3: 00-5:00 PM. y martes 3:00 – 6:00 PM.

1. OBJETIVOS

1. Proporcionar al estudiante los conceptos fundamentales de la teoría de la Inferencia Estadística y sus aplicaciones a la econometría.
2. Presentar y estudiar los modelos de Regresión Lineal simple y múltiple, analizando sus supuestos, sus aplicaciones y sus limitaciones.
3. Familiarizar al estudiante con el ambiente de los programas econométricos (**STATA**, **EViews**) y con el ejercicio de escribir rutinas derivadas de modelos estadísticos.
4. Dar elementos al estudiante que le permitan evaluar adecuadamente la aplicación de los diferentes modelos y herramientas estadísticas y econométricas presentadas en el curso, a problemas específicos formulados con base en una situación real.
5. Incentivar a los estudiantes de Economía a seguir explorando el área de los modelos econométricos. Específicamente que el estudiante siga la secuencia Econometría I, Econometría II, Econometría Avanzada (PEG con o sin énfasis en medio ambiente) y Tópicos en Econometría Avanzada.
6. Preparar al estudiante para los exámenes ECAES.
7. Aprender a manipular bases de datos con gran número de observaciones.

2. COMPETENCIAS A DESARROLLAR

Este curso se convierte en el primer contacto de los estudiantes con los métodos cuantitativos para las ciencias económicas. Al finalizar el curso se espera que el estudiante desarrolle las siguientes competencias:

Competencias básicas

- Tener la capacidad de análisis y síntesis: buscar causas, priorizar entre ellas, separar elementos centrales, respetar estándares, identificar y utilizar de manera adecuada un método apropiado para analizar cada problema y obtener resultados.
- Tener la capacidad de consultar fuentes de datos y organizarlos de forma analítica y simplificadora, entendiendo el significado de un dato o un número, siendo capaz de juzgar órdenes de magnitud.
- Tener la capacidad de manejar herramientas computacionales y de programar

Competencias de la disciplina

- Asimilar, apropiar y reproducir un canon de conocimiento en economía.
- Tener habilidad para aplicar el análisis formal a la comprensión de la realidad.
- Reconocer el énfasis cuantitativo de la disciplina y mostrar habilidades para el manejo cuantitativo. Desarrollar la capacidad de recolectar y/o construir datos.

3. METODOLOGIA

El programa del curso se cubrirá mediante dos sesiones semanales de hora y veinte minutos dirigidas por el profesor, las cuales serán utilizadas en la explicación detallada de los temas fundamentales del curso y en la solución de los interrogantes planteados por los estudiantes durante el desarrollo del mismo.

La parte práctica del curso (una sesión complementaria de hora y veinte minutos) consistirá en el desarrollo de ejercicios y talleres diseñados por el profesor asistente y el profesor, se realizarán algunos en las clases magistrales y gran parte en la hora de monitoría asignada. Durante las clases del profesor asistente se introducirán los temas y posteriormente se discutirán las rutinas o procedimientos computacionales asociados a la solución de problemas econométricos, con el fin de aclarar las dudas e inquietudes.

Periódicamente se desarrollarán talleres que buscan poner en práctica el trabajo realizado durante el curso. Se hará uso intensivo de los paquetes econométricos **STATA** (EViews) en la solución de los problemas que lo requieran. La participación activa y permanente de los estudiantes en las sesiones de clase y de taller, así como su trabajo permanente en la revisión de los conceptos teóricos que se van cubriendo y en la solución de los ejercicios y talleres asignados, constituyen una condición indispensable para el desarrollo exitoso del curso.

4. CONTENIDO

Sesión	Ref.	Tema
1	Gujarati, Wooldridge, Rosales y Bonilla	Introducción a la econometría. Conceptos básicos. Objetivos de la econometría. Organización de los datos.
2,3	Gujarati, Wooldridge	Introducción al modelo de regresión y supuestos del modelo <ul style="list-style-type: none">• Función de regresión poblacional y muestral• Supuestos del modelo de regresión
4 -7	Gujarati, Wooldridge	Modelo de regresión lineal simple con enfoque de sumatorias. <ul style="list-style-type: none">• Estimación por mínimos cuadrados ordinarios MCO• Propiedades de los estimadores (insesgados, eficientes, suficientes)• Intervalos de confianza de los coeficientes de regresión• Pruebas de hipótesis sobre los coeficientes de regresión (individual y global)• Estimación por máxima verosimilitud MV• Predicciones (predicción particular, predicción media)
8-11	Judge, Gujarati, Green, Wooldridge	Modelo de regresión lineal múltiple con enfoque de matricial. <ul style="list-style-type: none">• Estimación• Inferencia (pruebas de hipótesis, intervalos de confianza, R², R² ajustado, anova, prueba F, prueba t.• Análisis de Varianza• Predicción (predicción media, predicción individual)• Pruebas de hipótesis individuales y globales• Mínimos cuadrados restringidos (1 restricción, mas de una restricción)• Test Asimptoticos: Razón de Verosimilitud, Wald y multiplicador de Lagrange

		<ul style="list-style-type: none"> Estabilidad Estructural (prueba de Chow, prueba de la variable dicotómica, test cusum). Formas funcionales Contribución marginal de una variable
12,13	Gujarati, Wooldridge	Regresión con Variable Independiente Dicotómica <ul style="list-style-type: none"> Naturaleza de las variables dicotómicas Regresión con una variable cuantitativa y una variable cualitativa con dos clases o categorías Regresión con una variable cuantitativa y una variable cualitativa con más de dos clases Regresión con una variable cuantitativa y dos variables cualitativas Comparación de dos regresiones Efectos de Interacción
14	Judge, Gujarati, Wooldridge	No Normalidad y Multicolinealidad <ul style="list-style-type: none"> Origen Estimación en presencia de multicolinealidad Consecuencias Formas de detectarla Medidas remediales
15	Judge, Gujarati, Wooldridge	Heterocedasticidad <ul style="list-style-type: none"> Origen Estimación en presencia de multicolinealidad Consecuencias Formas de detectarla Medidas remediales
16	Judge, Gujarati	Autocorrelación <ul style="list-style-type: none"> Origen Estimación en presencia de multicolinealidad Consecuencias Formas de detectarla Medidas remediales

5. EVALUACION

2 Parciales	50% (25% c/u)
Quices	12,5% (en cada sesión complementaria sobre lo visto en clases anteriores)
Talleres	12,5%
Examen Final	25% (en la fecha planeada por la universidad)

Entrega del 30% de la nota	19 de marzo
Semana de trabajo individual	17 al 21 de marzo
Fecha límite de retiro:	28 de marzo
Ultimo día de clases:	9 de mayo

REGLAS IMPORTANTES DEL CURSO

- Las aproximaciones de las calificaciones finales se realizarán a partir de 3.0 según el esquema establecido por la Universidad. 2,99 es 2.5.
- Cualquier copia o intento de copia tendrá la sanción correspondiente según el Consejo de Facultad
- Los Talleres se realizarán en grupos de máximo dos personas de la misma sección. Todos los integrantes del grupo deben resolver (participar activamente) en conjunto cada uno de los puntos de los talleres y no dividirse la resolución de éstos (de los puntos y de los talleres).
- Los talleres deben ser entregados en la fecha especificada al inicio de la clase complementaria o en la fecha,

hora y lugar indicado por su respectivo complementario. Estos talleres deben ser presentados en hojas tamaño carta u oficio y en la parte superior debe aparecer claramente el nombre de los integrantes y la sección a la que pertenecen.

- Se tiene derecho a un supletorio siempre y cuando no se haya asistido al examen y el estudiante presente las excusas justificadas. Cuando por motivos de fuerza mayor el estudiante no asista a una evaluación o no entregue un taller en la fecha y hora indicada es importante efectuar aviso verbal al profesor o monitor con la debida anticipación. No obstante, esto no exonera al estudiante de presentar la correspondiente justificación escrita posterior dentro de los ocho días hábiles siguientes a la evaluación. No se aceptarán excusas transcurrido este periodo.
- Los reclamos sobre alguna evaluación deben hacerse en un plazo no mayor a una semana después de la fecha en que ésta ha sido entregada. Estos deben ser por escrito y sustentados de manera clara. En el caso de tareas y talleres este reclamo se debe realizar con el monitor o profesor asistente en horarios que se establecerán posteriormente.

BIBLIOGRAFIA

Textos Guía

- Gujarati, D. (2004). Econometría. Cuarta edición. Mc Graw Hill.
- Wooldridge J. (2000). Introducción a la Econometría. Thomson Learning.

Referencias

- Hill, R. Carter; Griffiths, William E., Judge, George G. (2000). Undergraduate Econometrics. 2nd Edition.
- Judge, George G.; Griffiths, William E.; Lutkepohl, Helmut; Hill, R. Carter; Lee, Tsoung-Chao. (1985), Introduction to the Theory & Practice of Econometrics. 2nd Edition.
- Rosales, Ramón y Bonilla, Jorge. (2006). Introducción a la Econometría. Apuntes de Clase No. 3. CEDE. Facultad de Economía. Universidad de los Andes.