

Profesor: Ramón Rosales ; rrosales@uniandes.edu.co
Profesor Taller: William Delgado; w-delgad@uniandes.edu.co
Profesor Taller: Juan Carlos Vásquez; jvasquez@uniandes.edu.co
Profesor Taller: Diego Javier Mariño; marinod@colpatria.com
Monitor: Alejandro Urrego; j-urrego@uniandes.edu.co
Monitor: Juan Sebastián Sánchez; jua-sanc@uniandes.edu.co
Monitor: Francisco Correa; fr-corre@uniandes.edu.co
Monitor: Carlos Morales; and-mora@uniandes.edu.co

Horario atención a estudiantes: Jueves de 10 a 12 AM en la Oficina 309 de la Facultad ó por Internet se puede acordar una cita.

1. INTRODUCCION

Teniendo como base el curso de Econometría 1, el curso de Econometría 2 está diseñado para abordar temas adicionales de los modelos de regresión que son comúnmente utilizados en la economía. En particular, el curso busca proporcionar los conceptos y el instrumental a nivel de pregrado de los modelos y métodos econométricos en los temas de sección cruzada y series de tiempo.

2. OBJETIVOS

- 2.1. Proporcionar a los estudiantes las bases para el manejo de los modelos y métodos econométricos utilizados en datos de sección cruzada y series de tiempo.
- 2.2. 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.
- 2.3. 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

- 3.1. Capacidad de analizar y sintetizar un problema económico desde el punto de vista econométrico.
- 3.2. Desarrollar en el estudiante capacidad critica en referencia a las diferentes técnicas econométricas aplicables a problemas económicos.
- 3.3. Capacidad para consultar, explorar y manipular bases de datos.
- 3.4. Manejar herramientas y procedimientos computacionales econométricos.
- 3.5. Familiarizar al estudiante con el proceso de investigación económica.

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 (Programas EVIEWS y STATA). Adicionalmente, se acordaran algunos días de monitoria.

5. EVALUACIÓN

Parcial 1	25%
Parcial 2	25%
Examen Final	25%
Taller	15%
Quices y tareas	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:

Reclamos se aceptan máximo hasta 8 días 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 4
- Primer parcial: Septiembre 22
- Entrega del 30%: Octubre 3
- Ultimo día para retiro: Octubre 10
- Semana de trabajo individual: Septiembre 29 – Octubre 3
- Segundo parcial: Noviembre 19
- Ultimo día de clases: Noviembre 21
- Exámenes finales: Noviembre 24 a Diciembre 9

7. CONTENIDO

7.1. Revisión conceptos y aplicaciones (Gujarati, Caps. 1 a 12; Wooldridge, Caps. 1 a 8; Hill et al., Caps. 1 a 12; Judge et al., Caps 8 y 9).

- Modelo de regresión clásico
- Mínimos cuadrados generalizados

7.2. Variables Instrumentales (Hill et al., Cap. 13; Wooldridge, Caps. 9 y 15).

- Endogeneidad
- Variables proxy
- Variables instrumentales
- Mínimos cuadrados bietapicos

7.3. Ecuaciones simultáneas (Gujarati, Cap. 18; Judge, et al., Caps. 14 y 15; Hill et al, Cap. 14 ; Wooldridge, Cap. 16).

- Especificación del modelo y sesgo de MCO
- Mínimos cuadrados indirectos - MCI
- Mínimos cuadrados en dos etapas – MC2E
- Mínimos cuadrados en tres etapas- MC3E y SUR

7.4. Datos de Panel (Gujarati, Cap. 16; Hill et al., Cap. 17; Wooldridge, Caps. 13 y 14).

- Estimador de diferencias en diferencias
- Modelos para datos panel: presentación general
- Efectos fijos
- Efectos aleatorios

7.5. Modelos con variable dependiente limitada (Gujarati, Cap. 15; Hill et al. Cap. 18; Wooldridge, Cap. 17).

- Modelos de probabilidad lineal
- Modelo probit
- Modelo logit
- Modelo Poisson

7.6. Modelos de rezagos distribuidos y autorregresivos (Gujarati, Cap. 17; Hill et al., Cap. 16; Wooldridge, Cap. 18).

- Modelo de rezagos distribuidos y autorregresivos
- Modelo de Koyck
- Modelo de Expectativas adaptativas
- Modelo de Ajuste Parcial

7.7. Conceptos básicos de series de tiempo (Gujarati, Cap. 18; Hill et al., Cap. 16; Wooldridge, Cap. 10).

- Definición, utilidad, aplicaciones y tipos de series de tiempo
- Objetivos del análisis de series de tiempo
- Gráfico y componentes de las series

7.8. Procesos estocásticos (Gujarati, Cap. 18; Hill et al., Cap. 16; Wooldridge, Cap. 11).

- Estacionariedad
- Función de autocovarianza y función de autocorrelación
- Raíz unitaria

7.9. Modelos para series estacionarias y no estacionarias (Gujarati, Cap. 22; Heij et al., Cap. 7; Maddala, Cap. 13; Montenegro, Cap. 3 y 4; Wooldridge Cap. 11).

- Procesos estocásticos de diferencia y de tendencia
- Operadores de rezago
- Modelo autorregresivo AR(1), AR(2) y AR(p)
- Modelo de media móvil MA(1), MA(2) y MA(q)
- Modelo ARMA(1,1), ARMA (p,q)
- Modelo ARIMA(p,d,q)

7.10. Metodología Box-Jenkins (Cap. 22 Gujarati; Heij et al., Cap. 7; Maddala, Cap. 14; Montenegro, Caps. 3 y 4; Wooldridge Cap. 11).

- Identificación
- Estimación
- Verificación y diagnóstico
- Pronóstico

8. BIBLIOGRAFIA

Greene, William (1998). *Análisis Económico*. Prentice Hall. Tercera Edición.

Gujarati, Damodar N.(2003). *Econometría*, McGraw Hill, New York. Cuarta Edición.

Heij, De Boer, Franses, Kloek, and Van Dijk (2004). *Econometric Methods with Applications in Business and Economics*. Oxford University Press.

Hill, R; W, Griffiths and G, Judge, 2001. *Undergraduated Econometrics*. John Wiley and Sons.

Judge, G.G., R.C. Hill, W.E. Griffiths, H. Lütkepohl, T-C. Lee (1988). *Introduction to the Theory and Practice of Econometrics*, John Wiley and Sons, 2nd ed.

Maddala, G.S. 2001. *Introduction to Econometrics*. Third Edition. Wiley.

Montenegro, Alvaro (2001). *Series de Tiempo*. Pontificia Universidad Javeriana. Facultad de Ciencias Económicas y Administrativas, Bogotá, D. C.

Wooldridge, J.M. (2006). *Introductory Econometrics: A Modern Approach*. Thomson.

Wooldridge, J.M. (2001). *Introducción a la Econometría*. Thomson.