

Profesor Taller sección 1: Jorge Perdomo; jor-perd@uniandes.edu.co

Profesor Taller sección 2: Felipe Cortés; fel-cort@uniandes.edu.co

Monitor: Alejandro Urrego; j-urrego@uniandes.edu.co

Horario de clase: Lunes y Miércoles de 10 a 11:20 AM. **Salón:** SD-716.

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 I, el curso de Econometría II está diseñado para abordar temas adicionales a la regresión simple y la regresión múltiple, que son comúnmente utilizados en la economía. En particular, el curso busca proporcionar los conceptos y el instrumental a nivel de pregrado de los 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 crítica 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	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: Enero 21
- Primer parcial: Marzo 10
- Entrega del 30%: Marzo 19
- Ultimo día para retiro: Marzo 28
- Semana de trabajo individual: Marzo 17 – Marzo 21
- Segundo parcial: Mayo 7
- Ultimo día de clases: Mayo 9
- Exámenes finales: Mayo 12 a Mayo 27

7. CONTENIDO

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

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

7.2. 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

- 7.3. 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
- 7.4. 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
- 7.5. 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
- 7.6. 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
- 7.7. Procesos estocásticos (Gujarati, Cap. 18; Hill et al., Cap. 16; Wooldridge, Cap. 11).**
- Proceso estocástico y ruido blanco
 - Proceso estocástico estacionario y no estacionario
 - Proceso estocástico de raíz unitaria
 - Proceso estocástico de tendencia estacionaria
 - Funciones de autocovarianza y autocorrelación
 - Pruebas de estacionariedad
 - Prueba de raíz unitaria
- 7.8. Transformación de series 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
 - Operador 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)
- 7.9. 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.