

Ak
53

UNIVERSIDAD DE LOS ANDES
FACULTAD DE ECONOMIA

TALLER DE ECONOMETRÍA I
PROGRAMA Sección 1 2002-2

Profesor Asistente: Monica Ospina L.

mon-ospi@uniandes.edu.co

Horario de atención: Miércoles de 9:00 a 11:00 a.m.

La estadística y la econometría hacen parte del conjunto de instrumentos de análisis que poseen los economistas para desarrollar trabajos de investigación. En la actualidad las posibilidades computacionales y programas de estimación han difundido enormemente estas herramientas logrando posicionar la dimensión cuantitativa y la validación empírica de la teoría dentro de esta disciplina.

En este contexto y considerando que tanto la práctica como los desarrollos teóricos en el campo econométrico incluyen un componente computacional significativo, el desarrollo de destrezas en el área de programación y el manejo de los programas estadísticos es fundamental para tener acceso a este instrumental.

1. Objetivo del Curso.

El propósito primordial del curso es proveer a los estudiantes las herramientas técnicas necesarias para implementar computacionalmente los conceptos teóricos del curso de Econometría I.

De igual manera se busca que al finalizar el curso los participantes estén familiarizados con el ambiente de los programas econométricos y con el ejercicio de escribir rutinas derivadas de modelos estadísticos.

2. Metodología de Trabajo.

El curso tiene una intensidad de dos horas semanales y guardará estrecha relación temática con el curso teórico (Econometría I), privilegiando las aplicaciones computacionales de los tópicos tratados.

Durante las clases se introducirán los temas y posteriormente se discutirán las rutinas o procedimientos asociados, con el fin de aclarar las dudas e inquietudes.

Periódicamente se desarrollarán talleres que buscan poner en práctica el trabajo realizado durante el curso.

3. Contenido

Temas del Curso:

- Introducción a Gauss.
 - Aspectos generales de la interfase del usuario.
 - Comandos básicos.
 - Instrucciones de entrada de datos.
 - Operaciones con arreglos y notación matricial.
 - Instrucciones Condicionales, Repetitivas y manejo de Datos.
- Regresión Lineal por el método de Mínimos Cuadrados Ordinarios (MCO) bajo Gauss.
 - Obtención de estimadores por MCO sin asistencia de librerías.
 - Líneas de Comandos de MCO básicas.
 - Inferencia estadística en el contexto de MCO.
 - Pruebas de estabilidad y cambio estructural.
- Estimación por Máxima Verosimilitud.
- Validación de los Supuestos de Gauss-Markov y herramientas de Diagnóstico de los Modelos.
 - Detección y corrección de Multicolinealidad (Librería LR).
 - Pruebas de Heterocedasticidad.
 - Detección y corrección de Autocorrelación.
- Introducción a Econometric Views.
 - MCO bajo Eviews.
 - Diagnóstico del modelo MCO en Eviews.

Temas Opcionales:

- Modelos Con Variables dependientes discretas.
 - Modelos Logit y Probit.
- Modelos de Rezagos y Expectativas.
- Introducción Series de Tiempo.
 - Identificación. Funciones de Autocorrelación y Autocorrelación Parcial, Integrabilidad.
 - Procesos AR(1) MA(1).

4. Evaluación

Para evaluar se realizarán 5 talleres de aplicación durante el semestre cada uno de los cuales corresponde al 20% de la evaluación del curso.

La nota final del curso se aproxima al múltiplo de 0.5 más cercano inclusive, es decir que 2.76 se aproxima a 3.0 y 2.75 se aproxima a 2.5

5. Bibliografía de Referencia.

Aptech Systems GAUSS. System and graphics manual. Maple Valley : Aptech Systems , 1994

Aptech Systems, 1996 GAUSS : mathematical and statistical system Supplement. Maple Valley, Washington : Aptech Systems.

Aptech Systems,1996. GAUSS : mathematical and statistical system. Maple Valley, Washington : Aptech Systems.

David M. Lilien [et al.], 1995. Eviews. Command and programming reference, version 2.0. Irvine : Quantitative Micro Software.

Granger, Clive W. J. 1999. Empirical Modeling in Economics. Specification and evaluation.

Greene. W 1998., Análisis Econométrico. Prentice-Hall. 1998. Tercera Edición.

Gujarati Damodar, Econometría, McGraw Hill, Tercera Edición, 1997.

Judge, George G. 1985 Introduction to the theory and practice of econometrics

George G. Judge [et al.]. John Willey and Sons.

Pindyck, Robert and Rubinfeld, Daniel. 1991. "Econometric Models and Economic Forecasts", McGraw Hill, Third Edition.

Direcciones Internet.

- Agricultural & Applied Economics. University of Wisconsin-Madison:
 - http://www.aae.wisc.edu/aae636/gausscode/gauss_book/ch1.html
- Applied Economics Research Group. Department of Economics. Portland State University:
 - <http://eclab.econ.pdx.edu/gpe/toc.htm>
- Department of Economics. Iowa State University:
 - <http://www.econ.iastate.edu/classes/econ573/herriges/GAUSS.pdf>
- Harvard-MIT Data Center:
 - <http://data.fas.harvard.edu/hdc/gausshelp.shtml>
- Statlab Yale University:
 - <http://statlab.stat.yale.edu/statlab/software/GAUSS.html>
- University of Southern California Research Computing Facility:
 - <http://www-rcf.usc.edu/~ridder/Lnotes/Econometrics/gaussint.pdf>