

Monitor: Jorge Armando Rueda Gallardo
e-mail: ja.rueda929@uniandes.edu.co

Programa del Curso

I. INTRODUCCION

El curso de Econometría hace parte del Área de Métodos Cuantitativos del Plan de Estudios de las Especializaciones de la Facultad. La Econometría es en una herramienta importante en el diseño y análisis de política. El contenido y desarrollo del curso es a nivel introductorio y está enfocado a la aplicación de los conceptos teóricos.

II. OBJETIVOS

- Proporcionar al estudiante las bases iniciales para el manejo de los métodos y modelos econométricos.
- Familiarizar al estudiante 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.

III. METODOLOGIA

El curso se desarrollará mediante sesiones de clases en las que se expondrán los conceptos teóricos, con ejemplos ilustrativos y la realización de ejercicios. Se dejarán talleres con el propósito de cimentar los conceptos teóricos y ganar destreza en el manejo del instrumental analítico, a través de la solución de problemas. Al final de cada capítulo se interpretarán salidas de computador (EXCEL, STATA) relacionados con los temas vistos. Se llevarán a cabo monitorias con el fin de replicar en el computador los conceptos vistos en clase.

IV. EVALUACION

Primer parcial 35%
Segundo parcial 35%
Talleres 30%

Es condición necesaria que el estudiante pase por lo menos un parcial para aprobar el curso.

Sistema de aproximación de notas definitivas

Dando alcance a la reciente modificación al sistema de calificaciones, el Comité Directivo, en la sesión No. 72-13 del 19 de junio de 2013, aprobó la siguiente escala de calificaciones incluida en el art. 49 del Reglamento General de Estudiantes de Especialización (RGEE):

“Las calificaciones definitivas de las materias serán numéricas de uno cinco (1,50) a cinco (5,00), en unidades, décimas y centésimas. La calificación aprobatoria mínima será de tres (3,00).”

V. CONTENIDO

CAPITULO 1. INTRODUCCION

- 1.1 Métodos cuantitativos de la economía.
- 1.2 Definiciones de econometría.
- 1.3 Procedimiento econométrico.
- 1.4 Modelo económico.
- 1.5 Modelo econométrico.
- 1.6 Componentes del modelo.

CAPITULO 2. ESTADISTICA

- 2.1 Objetivos de la estadística
- 2.2 Divisiones de la estadística
- 2.3 Tipos de variables y niveles de medición
- 2.4 Población y muestra
- 2.5 Parámetros poblacionales y estimadores
- 2.6 Medidas de tendencia central
- 2.7 Medidas de dispersión
- 2.8 Probabilidad y variables aleatorias
- 2.9 Distribuciones de probabilidad más importantes
- 2.10 Pruebas de hipótesis sobre la media y la varianza

CAPITULO 3. ANALISIS DE CORRELACION

- 3.1 Objetivo del análisis de correlación
- 3.2 Coeficiente de correlación simple
- 3.3 Prueba de hipótesis
- 3.4 Aplicación: Análisis de demanda
- 3.5 Aplicación: Análisis de oferta
- 3.6 Aplicación: Análisis de producción

CAPITULO 4. REGRESION SIMPLE

- 4.1 Objetivo del análisis de regresión
- 4.2 Función de regresión muestral y poblacional
- 4.3 Supuestos del modelo de regresión
- 4.4 Método de estimación de mínimos cuadrados ordinarios
- 4.5 Varianzas y errores estándar de los estimadores
- 4.6 Intervalos de confianza
- 4.7 Pruebas de hipótesis
- 4.8 Predicción
- 4.9 Aplicación: Funciones de demanda
- 4.10 Aplicación: Funciones de oferta
- 4.11 Aplicación: Funciones de producción

CAPITULO 5. REGRESION MULTIPLE

- 5.1 Especificación del modelo
- 5.2 Supuestos del modelo
- 5.3 Método de estimación de mínimos cuadrados ordinarios
- 5.4 Varianzas y covarianzas de los estimadores
- 5.5 Pruebas de hipótesis
- 5.6 Coeficiente de determinación ajustado
- 5.7 Intervalos de confianza
- 5.8 Aplicación: Funciones de demanda
- 5.9 Aplicación: Funciones de oferta

5.10 Aplicación: Funciones de producción

CAPITULO 6. REGRESION MÚLTIPLE NO LINEAL

- 6.1 Modelos de regresión cuadráticos
Aplicación: Funciones de producción
Aplicación: Funciones de utilidad
Aplicación: Funciones de costos
- 6.2 Modelos de regresión cúbicos
Aplicación: Funciones de producción
Aplicación: Funciones de costos
- 6.3 Modelos de regresión doblemente logarítmicos
Aplicación: Funciones de producción
Aplicación: Funciones de demanda
- 6.4 Modelos de regresión semilogarítmicos
Aplicación: Funciones de crecimiento

CAPITULO 7. MODELOS CON VARIABLES DICÓTOMAS

- 7.1 Naturaleza de las variables dicótomas
- 7.2 Modelos con variables independientes dicótomas
- 7.3 Modelos con variables independientes cuantitativas y dicótomas
- 7.4 Efectos de interacción de cuantitativas y dicótomas
- 7.5 Prueba sobre cambio estructural del modelo

CAPITULO 8. INTRODUCCION INCUMPLIMIENTO SUPUESTOS DEL MODELO

- 8.1 Multicolinealidad
- 8.2 Heteroscedasticidad
- 8.3 Autocorrelación
- 8.4 No normalidad y sesgo de especificación

VI. BIBLIOGRAFIA

- Canavos, George C.** 1988. Probabilidad y Estadística. Aplicaciones y Métodos. McGraw-Hill.
- Gujarati, Damodar y Porter Dawn** 2010. Econometría. McGraw-Hill.
- Rosales Ramón y Bonilla Jorge.** 2006. Introducción a la Econometría. Apuntes de Clase No. 3. CEDE. Facultad de Economía. Universidad de los Andes.
- Wooldridge, Jeffrey M.** 2010. Introducción a la Econometría: Un Enfoque Moderno. Thomson Learning. 4a. edición.