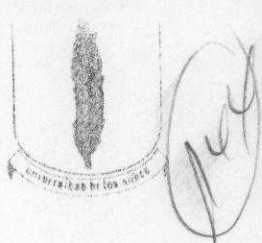


1



DEPARTAMENTO DE ECONOMIA  
PROGRAMA PARA EL CURSO DE ECONOMETRIA

Profesor Jaime Tenjo G.

Enero 1996

Horas de Consulta: Miercoles y Viernes 8:30 a 10:00 A.M.

### TEXTO.

- ↖ Griffiths, W.E., R.C. Hill y G.G. Judge: Learning and Practicing Econometrics. John Wiley & Sons. New York 1993.

### BIBLIOGRAFIA ADICIONAL.

Los siguientes libros pueden ser importantes como ayuda en diferente tópicos del presente programa. Se recomienda a los estudiantes hacer una revisión de dichos textos y usarlos en la medida en que les sea útiles.

- ↖ Johnston J. Econometric Methods. (third Edition). McGraw Hill, Inc. 1963
- Theil, Henri: Principles of Econometrics. John Wiley & Sonsa, INC. New York 1971
- ↖ Madala G.S.: Introduction to Econometrics (second edition) MacMillan, 1992
- ↖ Judge, G.G., W.E. Griffiths, R.C. Hill and T.C. Lee: The Theory and Practice of Econometrics. John Wiley & Sons. New York. 1980.
- Enders, Walter: Applied Econometric Time Series John Wiley & Sons. New York. 1995.

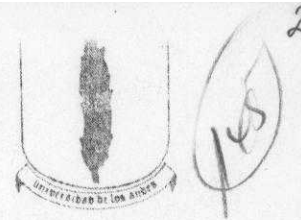
### OBJETIVOS DEL CURSO

El objetivo principal del curso es lograr que los estudiantes se familiaricen con las técnicas básicas de cuantificación mas comunes en investigación económica, con los problemas mas usuales en la aplicación de dichas técnicas y con las soluciones mas comunes a tales problemas. Al mismo tiempo se espera que los estudiantes desarrollen una capacidad minima para aplicar dichas técnicas en actividades investigativas.

### EVALUACIÓN

La evaluación se hará a través de parciales periódicos, la realización de un proyecto de investigación y un examen final. Habrá cuatro parciales de los cuales se ecogerán los tres con la nota mas alta. El peso de estos componentes es el siguiente:

Tres de cuatro parciales	60%
Trabajo de investigación	15%
Examen final	25%



El trabajo de investigación consiste en la selección y estimación de un modelo económico usando las técnicas econométricas aprendidas en el curso. Los resultados de tal investigación se deberán presentar por escrito en forma de artículo. Los detalles sobre los requerimientos de este trabajo se darán durante la primera semana de clase.

## COMENTARIOS GENERALES

1. Es imposible hacer trabajo econométrico serio sin la ayuda de computadores. Por esa razón se recomienda a los estudiantes que se familiaricen (si aún no lo están) con computadores en general y con algún programa econométrico serio. Algunos de los programas mas usados son LIMDEP, MINITAB, SAS, SPSS, STATA y TSP. Aunque cualquiera de estos programas contienen la mayoría (si no todo) el material necesario para este curso se recomienda especialmente familiarizarse con SAS o STATA. SAS es el programa que el libro usa y es uno de los programas mas versátiles que existen. STATA está disponible en el laboratorio del departamento de economía y los manuales van a estar disponibles en la biblioteca del CEDE.
2. Los estudiantes deben hacer todos los problemas del libro y consultar con el profesor si tienen dificultad en encontrar las soluciones.
3. En caso de faltar a algún parcial por enfermedad u otra causa mayor - sustentada con la documentación apropiada - el estudiante podrá pasar la nota de tal parcial al parcial siguiente, excepto en el caso del cuarto parcial. En este caso, la nota se basará en el promedio de los otros tres.
4. Las aproximaciones para el cálculo de la nota final se harán de la siguiente manera: Para que la nota se aproxime hacia arriba se requiere que el estudiante tenga mas de ,75 (.25) en el promedio (en mis cálculos yo mantengo hasta cuatro puntos decimales). Por ejemplo un estudiante que tenga 3,2500 baja a 3,0, mientras que uno con 3,2501 sube a 3,5. De lo anterior se exceptúan los estudiantes que obtengan mas de 4,0000 en el examen final en cuyo caso la aproximación hacia arriba se hace a partir de ,7001 (.2001).
5. Aunque el profesor trata de ser lo mas justo en la asignación de notas, algunos veces comete errores. En caso de que un estudiante considere que recibió una nota inferior a la merecida, debe hacerselo saber al profesor dentro de los ocho días siguientes al día en que los parciales sean devueltos en clase. Un breve resumen de las respuestas esperadas en cada examen se hará disponible en la oficina de fotocopias. No se aceptan reclamos el mismo día de entregarse los parciales (esto a fin de dar oportunidad a que el estudiante compare con las respuestas publicadas y se asegure de que tiene una buena razón de para



3

hacer el reclamo). Cuando el reclamo se debe a que dos (o mas) estudiantes tienen respuestas muy similares pero notas muy diferentes, el estudiante que hace el reclamo debe presentar el examen en que basa su compración (es posible que en error esté en el examen con la nota alta).

- 6. Cambios a este programa se anunciarán en clase. Es obligación de los estudiantes informarse de dicho cambios.

### CRONOGRAMA

Enero 17	Introducción, Capítulo 1
Enero 19-24	Repaso de conceptos estadísticos. Capítulos 2 a 4
Enero 24-Feb 7	Modelo de regresión simple. Capítulos 5 a 8
Febrero 9	PRIMER PARCIAL. Capítulos 2 a 7.
Febrero 14-Marzo 1	Modelo de regresión múltiple. Capítulos 9 a 13.
Febrero 28	SEGUNDO PARCIAL. Capítulos 5 a 13 (excepto el 12)
Marzo 6-8	Modelos con regresores aleatorios y Teoría de Muestras Grandes. Capítulo 14.
Marzo 13-22	Problemas de Matrices de Covarianza noEscalares. Capítulos 15 y 16
Marzo 27-Abril 10	Relaciones económicas a través de los términos de errores. Capítulo 17.
Marzo 29	TERCER PARCIAL. Capítulos 9 a 16.
Abril 10-19	Modelos de Ecuaciones Simultaneas. Capítulos 18 y 19.
Abril 19-24	Series de Tiempo. Capítulos 20 a 21.
Abril 26	CUARTO PARCIAL. Capítulos 17 a 21.
Mayo 3-8	Modelos en los que la variable dependiente es una variable dummy. Capítulo 23.

### FECHAS IMPORTANTES

FEBRERO 9	PRIMER PARCIAL
FEBRERO 28	SEGUNDO PARCIAL
MARZO 29	TERCER PARCIAL
ABRIL 26	CUARTO PARCIAL
MAYO 3	ARTICULO DE INVESTIGACION