

1

Econometría I
Programa

Profesora: Rocío Ribero
Oficina: 209 CEDE
Extensión: 2412

Horas de oficina:

Objetivos:

El curso está diseñado para introducir a los estudiantes en el análisis de datos y la econometría. El alumno debe llegar a comprender la teoría estadística y econométrica para conducir investigación empírica en economía, y a usar de manera inteligente los instrumentos econométricos.

Organización:

Se cubrirán primero los conceptos básicos de probabilidad y estadística. Luego se estudiará el modelo de regresión.

Se espera que el alumno ponga en práctica lo aprendido en este curso en el Taller de Econometría (paralelo) donde aprenderá a manejar un paquete econométrico para manipular la información y estimar los modelos econométricos.

Libros:

Textos (No es necesario tener los dos libros)

(G) Gujarati, D. (1995) Basic Econometrics, 3rd Edition, Mc, Graw Hill

(J) Judge, Hill, Griffiths, Lutkepohl y Chao-Lee (Mejor conocido como Judge)

"Introduction to the theory and practice of econometrics" Second Edition, Wiley and Sons 1988

Otros libros de consulta:

Chiang. "Metodos fundamentales de economia matematica" Tercera Edición. Mc Graw Hill. 1987

Meyer. "Probabilidad y aplicaciones estadísticas" Fonde Educativo Ineramericano. 1986

Libros avanzados de econometría:

Green, "Econometric Analysis" Third Ed. Prentice Hall, 1997.

Judge, Hill, Griffiths, Lutkepohl y Chao-Lee (Mejor conocido como Judge avanzado)

"The theory and practice of econometrics" Second Edition, Wiley and Sons 1985

Theil "Principles of Econometrics" Wiley, 1971.

- | | |
|--|---------------------|
| 0. Introducción | J 1, G Introduction |
| 1. Bases de inferencia estadística | J 2 |
| 1.1. Análisis de datos y estadística descriptiva | |
| 1.2. Probabilidad | |

1.3. Teoría de distribución	
1.4. Algunas distribuciones importantes	
2. Inferencia estadística	J 3, G 4
3. Modelo Clásico Lineal de Regresión	J 5, G 1, 5, 8, 9
3.1 Regresión Lineal Clásica	G 9, J 5
3.2 Test de Hipótesis	G 8, J 6.4
3.3 Variables Dummy	G 15, J 10.2
4. Relajación de las hipótesis del modelo	
4.1 Multicolinealidad	G 10, J 21
4.2 Errores de especificación	G 13
4.3 Heteroscedasticidad	G 11, J 9.3
4.4 Autocorrelación	G 12, J 9.5 y 9.6

Evaluación

Primer Parcial	21 de Septiembre	35%
Examen Final	fecha asignada al final del semestre	35%
Talleres	Un taller semanal	30%

Notas

El tema de cada taller será asignado al final de la sesión de cada jueves.

Los talleres deben ser entregados al inicio de la clase del martes cada semana. El promedio de los talleres se calculará excluyendo el taller con la nota más baja.

La semana del parcial y la última semana de clases no habrá talleres sino sesiones de repaso y solución de dudas.

La metodología de aproximación de las notas será hacia el n.5 más cercano. Si la nota final queda en 3.25 se aproxima a 3.5, pero si queda en 3.24 se aproxima a 3.0.

El alumno que se descubra copiando en el parcial o el examen recibirá 1.0 como nota definitiva del curso, independientemente de cualquier otra nota que haya obtenido en el curso.