

OK
5/3

Econometría 1

Programa – Semestre I - 2001

Profesora: Rocío Ribero
Oficina: 307 CEDE
Extensión: 2412
Email: rribero@uniandes.edu.co

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 hará una revisión rápida de los conceptos básicos de probabilidad y estadística. Luego se estudiará el modelo clásico de regresión lineal, que se basa en el criterio de Mínimos Cuadrados Ordinarios. Luego de entender bien el modelo general y todos sus supuestos, se levantarán estos supuestos para ver los fenómenos de autocorrelación y heteroscedasticidad. Se verán también multicolinealidad y errores de especificación. Se introducirá el concepto de variables dummies y de modelos en los cuales la variable dependiente es dicotómica.

Se espera que el alumno ponga en práctica lo aprendido en este curso en el Taller de Econometría (correquisito) donde aprenderá a manejar un paquete econométrico para manipular la información y estimar los modelos econométricos. Se espera que los trabajos que se asignan en este curso sean resueltos con la ayuda del paquete econométrico que allí se les enseña.

Texto guía:

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

También está disponible en Español.

El texto debe estar disponible en la librería de la Universidad.

Otros libros de consulta:

- (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

- (R) Ramanathan “Introductory Econometrics with Applications” 4th Bk&Dk Edition 1997
- Meyer. “Probabilidad y aplicaciones estadísticas” FONDE Educativo Ineramericano. 1986

Libros avanzados de econometría:

- Green, “Econometric Analysis” Fourth Ed. Prentice Hall, 1999.
- 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.

Temas

0. Introducción	G Introduction
1. Repaso de Probabilidad y Estadística	J 2
1.1. Análisis de datos y estadística descriptiva	
1.2. Probabilidad	
1.3. Teoría de distribución	
1.4. Algunas distribuciones importantes	
1.5. Estimadores y Propiedades	R 2
2. Análisis de Regresión	G 1
3. Modelo Clásico Lineal de Regresión con dos variables	G 2
3.1 Estimación	G 3
3.2 Supuesto de Normalidad	G 4
3.3 Tests de Hipotesis y Estimación de Intervalos	G 5
3.4 Regresión al origen y Formas Funcionales	G 6
3.5 Coeficiente de Determinación (R-cuadrado) y Coeficiente de Correlación	
	G 7 sec.7.8 y 7.9
4. Enfoque Matricial al Modelo de Regresión	G 9, J 5

2

5. Variables Dummy	G 15
6. Relajación de las hipótesis del modelo	
6.1 Multicolinealidad	G 10
6.2 Errores de especificación	G 13
6.3 Heteroscedasticidad	G 11, J 9
6.4 Autocorrelación	G 12
7. Regresión con Variables dependientes Dummy	G 16
(si el tiempo lo permite)	

Metodología de Evaluación

• Primer Parcial	Miercoles 28 de Febrero	25%
• Segundo Parcial	Miercoles 4 de Abril	25%
• Examen Final	Fecha asignada al final del semestre	35%
• Talleres y Quices	Un taller cada dos semanas aprox.	15%

Notas

- La metodología de aproximación de las notas será hacia el n.5 más cercano. Por ejemplo 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.
- El examen final es acumulativo, es decir incluye todo el tema visto en el curso.
- Los quices son sorpresa.
- Las fechas de los parciales no se cambiarán después del 1 de Febrero.