

Econometría I

Programa Segundo Semestre 2001

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

Horario:
Salon:
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, así como los problemas de especificación del modelo y de multicolinealidad. Se introducirá el concepto de variables dummies y se darán ejemplos de su uso práctico. También se verán modelos sencillos 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 está disponible en la librería de la Universidad y en la mayoría de las librerías especializadas.

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 Edition. Dryden. 1998
- (HGJ) Hill, Griffiths y Judge. “Undergraduate Econometrics” Second Edition. Wiley. 2000

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 del Curso

0. Introducción	G Introduction
1. Repaso de Probabilidad y Estadística	
1.1. Análisis de datos y estadística descriptiva	J 2
1.2. Probabilidad	J 2
1.3. Teoría de distribución	J 2
1.4. Algunas distribuciones importantes	J 2
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

5. Estimador de Máxima Verosimilitud	J 3, G 4A
6. Variables Dummy	G 15
7. Relajación de las hipótesis del modelo	
7.1 Multicolinealidad	G 10
7.2 Errores de especificación	G 13
7.3 Heteroscedasticidad	G 11, J 9, HGJ 11
7.4 Autocorrelación	G 12, HGJ 12
8. Regresión con Variables dependientes Dummy	G 16
(si el tiempo lo permite)	

Metodología de Evaluación

• Primer Parcial	25%	Fecha:
• Segundo Parcial	25%	Fecha:
• Examen Final	35%	Fecha:
• Talleres y Quices	15%	

Notas

- La metodología de aproximación de las notas será hacia el n.5 más cercano. De 3.25 se aproxima a 3.5, pero de 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 excepto el repaso de Probabilidad y Estadística.
- Los quices son sorpresa.
- No se recibe una nota aprobatoria a menos que el promedio (ponderado o sin ponderar) de los parciales y el examen sea superior o igual a 3.0.

20
1/5

ECONOMETRIA I

TALLERES:

AGOSTO

21 Taller 1

SEPTIEMBRE

4 Taller 2

18 Taller 3

OCTUBRE

9 Taller 4

23 Taller 5

NOVIEMBRE

6 Taller 6

20 Taller 7

PARCIALES:

SEPTIEMBRE

20 Primer Parcial

NOVIEMBRE

1 Segundo Parcial

22 Examen Final