

## Econometría 1 – Programa – Primer Semestre 2003

Profesora: Rocío Ribero M.  
Oficina: 307 CEDE Ext. 2412  
Correo electrónico: [rribero@uniandes.edu.co](mailto:rribero@uniandes.edu.co)

Monitora: Angela León  
Correo electrónico: [@uniandes.edu.co](mailto:@uniandes.edu.co)

### Objetivos

El curso está diseñado para que los estudiantes se familiaricen con el análisis de datos y las herramientas econométricas. El estudiante debe llegar a comprender la teoría estadística y econométrica para poder conducir solo investigación empírica en economía, y a usar de manera inteligente los instrumentos a su alcance.

### Organización

Tras revisar rápidamente los conceptos básicos de probabilidad y estadística, se estudia el modelo clásico lineal de regresión con dos variables, basándose en el criterio de Mínimos Cuadrados Ordinarios. Luego se introduce el supuesto de Normalidad para poder hacer inferencia estadística con los estimadores de MCO. Luego el modelo se generaliza a  $k$  variables y se estudia en forma matricial. Se presenta también el estimador de Máxima Verosimilitud. Al final del curso se estudian los fenómenos que ocurren al levantarse los supuestos básicos del modelo clásico.

El estudiante debe complementar el curso con el Taller de Econometría 1 en el cual pondrá en práctica los conceptos aprendidos en el curso, a través del manejo de paquetes econométricos como Gauss, Eviews o Stata.

### Texto guía que se recomienda comprar:

(G) Gujarati, Damodar. "Econometría Basica." 3ra edición. Mac Graw Hill. 1995

### Otros textos que se utilizan en el curso:

(W) Wooldridge, Jeffrey M. "Introducción a la Econometría, un enfoque moderno"  
Thomson Learning. 2001

(J) Judge, Hill, Griffiths, Lutkepohl y Chao Lee. "Introduction to the theory and practice of econometrics" Second Edition. Wiley and Sons 1988

(HGJ) Hill, Griffiths, Judge. "Undergraduate Econometrics" Second Edition. Wiley 2000

(R) Ramanathan. "Introductory Econometrics with applications" 4th Edition. Dryden. 1998

(Gr) Greene. Análisis Econometrico. 4th Edition. Prentice Hall, 1999.

### Temas

I.	Introducción	
	1. Marco conceptual y ejemplos	G1
	2. Los datos económicos	W1
	3. Repaso de probabilidad y estadística	J2
	4. Estimadores y propiedades	R2
II.	Análisis de Regresión	
	1. El modelo de regresión con 2 variables	G2
	2. Estimación y resultados del modelo	G3
	3. Coeficiente de determinación y de correlación	G3
III.	Inferencia Estadística y Normalidad	
	1. El supuesto de normalidad	G4
	2. Pruebas de hipótesis e intervalos de confianza	G5
	3. Tabla Anova	G7, Gr7
	4. Regresión al origen	G6
	5. Predicción con el modelo de MCO	G5
	6. Formas funcionales y elasticidades <i>(Aproximadamente primer parcial)</i>	G6
IV.	El modelo de k variables	
	1. Enfoque matricial	G9, J5
	2. Estimación y resultados del modelo	G9
	3. Tabla Anova en forma matricial y prueba F	G9
	4. Regresión al origen para este modelo	G9
	5. Pruebas de hipótesis lineales con varios coeficientes	J5
V.	Máxima Verosimilitud	J3, G4apen.
	1. El estimador de MV	
	2. Comparación con el estimador de MCO	
VI.	Variables Binarias o Ficticias <i>(Aproximadamente segundo parcial)</i>	G15, W7
VII.	Violación de los supuestos del modelo	
	1. Errores de especificación	G13, W9
	2. Multicolinealidad	G10
	3. Heteroscedasticidad	G11, J9, HGJ11, W8
	4. Autocorrelación	G12, HGJ12
VIII.	Modelos de respuesta cualitativa ( si el tiempo lo permite)	G16

## Metodología de Evaluación

Primer Parcial	25%
Segundo Parcial	25%
Tareas y Quices	10%
Examen Final	30%
Taller de Econometría 1	10%

Habrá que resolver aproximadamente 7 tareas en el curso, las cuales se deben entregar a la monitora el día de la monitoría al inicio de la clase. Se pueden hacer en grupos de máximo 3 estudiantes. Si no se entrega a tiempo la tarea, se calificará sobre 3.5 dentro de la semana siguiente a la fecha de entrega. Después de una semana de la fecha de entrega, la tarea no se calificará y se pondrá un 1 en esa nota.

Los quices pueden ser sorpresa o pueden ser avisados. La asistencia a clase o a monitorías no es obligatoria, pero quien no asiste a un quiz no lo puede presentar después sino que saca un 1 en esa nota. Cada dos quices equivalen a la nota de un taller.

**Aproximaciones:** 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. Para pasar el curso se debe tener un promedio (aritmético o ponderado con las ponderaciones de cada prueba) de más de 2.90 en los dos parciales y el examen final. 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.

**NO HABRÁ EXCEPCIÓN ALGUNA A ESTAS REGLAS.**

**Revisiones de notas:** Solamente se aceptarán revisiones de las notas de las pruebas (parciales, examen final, tareas o quices) dentro del plazo de una semana después de la fecha de entrega de la prueba calificada. No se realizarán cambios en ninguna nota después del examen final (excepto revisiones en ésta última prueba).

**Horas de oficina profesora:** Viernes 9 –12 a.m. o por cita previa por correo electrónico.

**Horario de atención Monitora**

**Fechas de entrega de tareas**

**Fechas Parciales**