

Profesor: German Botero A.

Econometria es la rama de la economia que se dedica a estimar empiricamente relaciones derivadas de la teoria economica. Este curso desarrolla las tecnicas de estimacion de modelos econometricos lineales de una sola ecuacion e introduce tecnicas de estimacion de modelos de ecuaciones simultaneas. Su objetivo es lograr que el estudiante aplique las herramientas de la econometria consistentemente con la teoria economica.

Evaluacion

2 exámenes parciales: 50%
1 examen final : 25%
4 tareas : 25%

Bibliografia

1. M.D. Intriligator, Econometric Models, Techniques and Applications (Int.) 330.018/161e
2. Damodar Gujarati, Econometria Basica, Mc Graw-Hill, 330.018/5969 Latinoamericana.
3. Pindyck & Rubinfeld, Econometric Models and Economic Forecast (P&R) 338.544/P648e
4. G.S. Madala, Econometrics, Mc Graw-Hill Book Co. 330.018/1179e
5. H. Theil, Principles of Econometrics, John Wiley & Sons. 330.18/1344

Programa

Enero 17, 19 El proceso econometrico

- 1.1 Generalidades (Int. Cap 1)
- 1.2 Modelos econometricos (Int. Cap 2.1 a 2.5)
- 1.3 Datos (Int. Cap 3)

- 2
- En 24 2. Modelo de regresion lineal simple
- 2.1 Estimacion informal (Int. Cap 4.3)
- 2.2 Estimacion formal: minimos cuadrados ordinarios (Int 4.4, P&R Cap 1.)
maximizacion funcion de verosimilitud (Int. 4.5, P&R A3.2)

Distribucion

✓ Tarea No.1 para entregar Enero 31

En 26 3. Repaso de algebra matricial

4. Modelo basico de regresion multiple

- En 31 4.1 Introduccion (Int. 4.6, P&R 4.4)
- Feb 2 4.2 Estimacion por minimos cuadrados ordinarios (Int. 4.6, P&R 3.2, 4.2, 4.3)
- Feb 6 4.3 Propiedades de los estimadores (Int. 4.8, 5.2; P&R 3.3, 3.4)
- Feb 9 4.4 Teorema de Gauss-Markov (Int. 4.9, P&R 3.2)
- F 13,15 4.5 Pruebas de Hipotesis (Int. 5.3, 5.4; P&R 3.3, 3.4)
- Feb 22 4.6 Prediccion (Int. 4.10; P&R 8.1)

Feb 28 Examen Parcial

Maz 2 Correccion examen parcial; distribucion tarea No.2 para entregar Marzo 9

5. Problemas en el modelo basico de regresion lineal

- Mz 7 5.1 Multicolinealidad (Int. 6.2; P&R 4.4)
- 5.2 Violaciones de los supuestos del teorema de Gauss-Markov:
- Heteroskedasticidad (Int. 6.3; P&R 6.1)
- Correlacion serial (Int. 6.4; P&R 6.2)
- Mz 7
- Mz 9
- Mz 14,16 5.3 Estimacion por minimos cuadrados generalizados (Int. 6.5; P&R A6)
- Mz 28,30 5.4 Estimacion de modelos con variables rezagadas (Int. 6.7; P&R 13.1, 13.2)
- 5.5 Otras violaciones a los supuestos del Teorema de Gauss-Markov
- Errores de especificacion (Int. 6.8)
- Errores en las variables (Int 6.9)
- Abr 1
- Abr 4

Abr 6 Examen Parcial

Abr 11 Correccion examen parcial; distribucion Tarea No.3 para entregar Abril 18

6. Introduccion a la estimacion de modelos de ecuaciones simultaneas

- Abr 13 6.1 Modelos de ecuaciones simultaneas

Abr 18,20 6.2 Variables instrumentales (Int. 11.6)

Abr 20 Distribucion Tarea No. 4 para entregar Abril 27

7. Introduccion a la estimacion de modelos de escogencia
cualitativa

Abr 25 7.1 Modelos de escogencia cualitativa

Abr 27

My 2 7.2 Estimacion de modelos de escogencia cualitativa