

1
OK
L.S.

UNIVERSIDAD DE LOS ANDES
FACULTAD DE ECONOMÍA

ECONOMETRÍA I

Segundo Semestre de 2000
Profesor: Roberto Ayala

OBJETIVOS

El objetivo del curso es familiarizar al estudiante con las principales herramientas econométricas que son necesarias para el manejo de datos, la aplicación y validación empírica de las teorías económicas. En particular, el curso se concentrará en el análisis del modelo de regresión lineal como un primer paso para sentar sólidas bases para cualquier estudio de Econometría avanzada.

METODOLOGÍA

La metodología a utilizar durante el curso será la presentación de la materia por parte del profesor, involucrando para ello la participación activa de los estudiantes en el análisis y desarrollo de los temas. El curso se complementa con tareas asignadas para cada tema, así como con las clases de taller que serán dictadas por el profesor auxiliar y en las que los estudiantes se familiarizarán con paquetes estadísticos como aquellos incorporados en MS Excel, *Econometric Views* y Gauss.

BIBLIOGRAFÍA

- Greene, William H. (1997).** "Econometric Analysis". Third Edition. Prentice Hall. (GR)
Gujarati, Damodar (1997). "Econometría". Tercera Edición. McGraw-Hill. (G)
Johnston, Jack y Dinardo, John (1997). "Econometric Methods". Fourth Edition. McGraw-Hill. (J)
Maddala, G. S. (1996). "Introducción a la Econometría". Segunda Edición. Prentice Hall. (M)

PROGRAMA

1. Revisión de conceptos: Estadística Descriptiva e Inferencial.

(*) G. Apéndice A.

(*) M. Cap. 2.

GR. Cap. 3 y 4.

2. Modelo de Regresión Lineal Simple.

(*) G. Cap. 2, 3, 4, 5, 6.

(*) M. Cap. 3

J. Cap. 1, 2.

3. Modelo de Regresión Lineal Múltiple.

(*) G. Caps. 7, 8.

(*) M. Cap. 3.

J. Cap. 3.

GR. Cap. 6.

4. Revisión de conceptos: Álgebra Lineal.

(*) M. Apéndice de los capítulos 2,7.

G. Apéndice B.

5. Enfoque matricial del modelo de regresión lineal múltiple.

(*) G. Cap. 9.

(*) M. Cap. 4.

J. Cap. 3,4.

GR. Cap. 6, 7.

6. Autocorrelación.

(*) G. Cap. 12.

(*) M. Cap. 6.

(*) J. Cap. 6.

GR. Cap. 13.

7. Heterocedasticidad.

(*) G. Cap. 11.

(*) M. Cap. 5.

(*) J. Cap. 6

GR. Cap. 12.

8. Multicolinealidad

(*) G. Cap. 10.

(*) M. Cap. 7.

GR. Cap. 9.

(*): lectura obligatoria.

EVALUACIÓN

La puntuación final de cada parcial estará ponderada de la siguiente manera:

Tareas	15%	
Primer parcial:	25%	(Fecha probable: Viernes 22 de Septiembre)
Segundo parcial:	25%	(Fecha probable: Viernes 24 de Noviembre)
Examen Final:	35%	

El sistema de aproximación de las notas finales se hará de la siguiente manera:

Notas Finales con cifras decimales comprendidas entre:		Aproximación
0,000	0,249	0-
0,250	0,499	0,5
0,500	0,749	0,5
0,750	0,999	0+

Sin embargo, la nota necesaria para aprobar el curso deberá ser por lo menos 3,000. De esta manera, la aproximación para la nota final descrita anteriormente no será válida para las calificaciones comprendidas entre 2,75 y 2,999.