

Alejandro GARCIA
Universidad de Los Andes
Facultad de Economía

Econometría I

Primer Semestre de 2002

Objetivos

La econometría es el estudio sistemático de las relaciones empíricas entre variables socioeconómicas. La econometría puede entenderse como un conjunto de instrumentos que permiten: (i) describir de manera exhaustiva las regularidades empíricas que existen en la realidad económica y social, y (ii) evaluar la validez de las teorías económicas y sociales.

La materia prima de la econometría son los datos (sin datos la econometría es poco más que letra muerta). El andamiaje de la econometría está dado por la teoría estadística (la econometría es una rama de la estadística aplicada). Por ello, es importante aprender a manejar los datos y tener un conocimiento cabal de los conceptos estadísticos básicos.

Este curso persigue tres objetivos fundamentales: (i) familiarizar al estudiante con el trabajo empírico, (ii) introducir los conceptos econométricos fundamentales y (iii) ofrecer una primera idea acerca de cómo se hace investigación aplicada en economía.

Metodología y evaluación

El curso enfatizará los aspectos intuitivos. Los aspectos algebraicos y operativos serán presentados de manera subsidiaria. Todos los conceptos serán ilustrados con ejemplos y aplicaciones reales. Aunque la mayoría de las clases consistirán en exposiciones magistrales, la participación es muy importante y será estimulada permanentemente.

Evaluación:

Examen parcial (30%)

Examen final (30%)

Quices y trabajo (30%)

Programa

Semanas 1, 2 y 3a. **Repaso estadístico:** relaciones entre variables, distribuciones univariadas y bi-variadas e inferencias acerca de la media de una población.

Semanas 3b, 4 y 5. **El modelo clásico:** estimación e inferencia en el modelo clásico. Predicción y ajuste.

Semanas 5 y 6. **Regresiones múltiples:** estimación e inferencia. Pruebas de hipótesis

Semana 7a. **Parcial.**

Semana 7b. **Resolución del parcial y repaso.**

Semana 8. **Relajando los supuestos del modelo clásico:** definiciones y conceptos principales.

Semana 9. **Heteroscedasticidad:** pruebas de hipótesis y modelos alternativos.

Semanas 10. **Autocorrelación:** pruebas de hipótesis y modelos.

Semana 11 y 12. **Modelos binarios:** definición, modelos Probit y Logit. Estimación.

Semanas 13 y 14. **Simultaneidad:** conceptos fundamentales, estimación e identificación. Variables instrumentales.

Semana 15. **Repaso y revisión de trabajos.**

Examen Final

Bibliografía

Textos principales:

Goldberger, A., 1998, Introductory Econometrics, Harvard University Press.

Goldberger, A., 1991, A Course in Econometrics, Harvard University Press.

Kennedy, P., 1998, A Guide to Econometrics, MIT Press.

Profesor: Alejandro Gaviria

Email: agaviria@fedesarrollo.org.co

Tel: 312-5300.