

ECON 218
Econometría I
2002 Semestre I

Horario: Martes y Jueves, 4:00-6:00 p.m.

Salón: AU 208

Profesor: Norman Offstein

Objetivos

El concepto detrás del curso es principalmente introducir a los estudiantes el análisis de datos y la econometría. El alumno debe llegar a comprender la teoría estadística y econométrica para conducir investigación empírica, y a usar de manera correcta los instrumentos econométricos.

Organización

Se empieza el curso con una introducción al modelo sencillo una revisión estadística. Después comenzamos con el modelo sencillo de mínimos cuadrados y los supuestos. Además, el curso está organizado por temas y semanas. Lo siguiente es una lista de temas que se va a cubrir en todas las sesiones.

Tareas

Inicialmente, se espera asignar aproximadamente 8 tareas durante el semestre. Los estudiantes pueden trabajar en grupos de dos si prefieren.

Textos

El texto principal del material presentado en la clase es:

Hill, R. Carter, William E. Griffiths, y George G. Judge (2001) *Undergraduate Econometrics*, 2nd ed., John Wiley & Sons, New York, (HGJ)

Gujarati, Damodar N., (1995), *Basic Econometrics*, 3rd ed., McGraw Hill, New York (G)

Material de cada curso

Semana 1

1. Introducción Capitulo 1

Semana 2

2. Conceptos Básicos de Probabilidad

Semana 3

3. Modelo sencillo y sus supuestos, derivación del modelo (Cap. 3 HGJ y Cap. 3 G)
4. Propiedades estadísticas del modelo sencillo, Guass-Markov (Cap. 4 HGJ y Cap. 3 G)

Semana 4

5. Inferencia estadística, prueba de hipótesis con t , errores tipo I y II, valor p (Cap. 5 **HGJ** y Cap. 5 **G**)
6. R^2 , usando escalas (scaling data), formas funcionales (Cap. 6 **HGJ** y Cap. 3.5, 6 **G**)

Semana 5

7. Review
8. Parcial 1

Semana 6

9. Modelo de regresión múltiple, supuestos revisados (Cap. 7 **HGJ** y Cap. 7 **G**)
10. Prueba de F , variables omitidos, variables irrelevantes, colinearidad (Cap. 8 **HGJ** y Cap. 8 **G**)

Semana 7

11. Modelo múltiple en forma de matrices
12. Variables dummy (Cap. 9 **HGJ** y Cap. 9 **G**)

Semana 8

13. Continuación variables dummy (Cap. 9 **HGJ** y Cap. 9 **G**)
14. Modelos no-lineales (en variables) (Cap. 10, 11 **HGJ** y Cap. 11 **G**)

Semana 9

15. Heteroscedasticidad (Cap. 11 **HGJ** y Cap. 11 **G**)

Semana 10

16. Autocorreclación (Cap. 12 **HGJ** y Cap. 12 **G**)

Semana 11

17. Review parcial 2
18. Parcial 2

Semana 12

19. Maximum likelihood (Appendix 4A **G**)
20. Random regressors, estimación con variables instrumentales (Cap. 12 **HGJ**)

Semana 13

21. Distributed lag models y Modelos Autoregresivos (Cap. 12 **HGJ** y Cap. 12 **G**)

22. Regresiones con series de tiempo (Cap. 16 **HGJ** y Cap. 21 **G**)

Semana 14

23. Qualitative and limited dependent variables, probit, logit, tobit (Cap. 18 **HGJ** y Cap. 16 **G**)

Semana 15

24. Review examen final

25. Examen final

Fechas de exámenes

Parcial 1	febrero 12
Parcial 2	abril 4
Examen final	mayo 2 (?)

Notas

Tareas	17%
Parcial 1	26%
Parcial 2	26%
Examen Final	31%

Dos puntos adicionales:

1. Aproximación de notas sería en intervalos 0.25, así una nota de 3.75 se aproxima a 4 y 3.74 a 3.5.
2. Para pasar el curso, hay que tener un promedio mínimo de 3.00 en los tres exámenes.