

ECON 218
Econometría I
2003 Semestre II

Horario: Lunes y Miércoles 1:00-3:00 p.m.
Salón: AU 303
Profesor: Norman Offstein
Correo electrónico: noffstei@uniandes.edu.co
Horas de oficina: Miércoles 3:00-5:00 p.m.

1. Objetivos

El concepto detrás del curso es principalmente introducir a los estudiantes el análisis de datos a través de la regresión sencilla y la regresión múltiple. El alumno debe llegar a poder hacer econometría con un paquete estadístico y analizar e interpretar los resultados para conducir investigación empírica.

2. Organización

Se empieza el curso con una introducción al concepto de econometría, una corta revisión estadística y el modelo sencillo. Se introduce el procedimiento de mínimos cuadrados y los supuestos. Se presenta el modelo múltiple y los problemas cuando los supuestos del modelo no se cumplen. Si el tiempo permite, se incluirá una corta introducción a series de tiempo.

Adicional al curso se requiere el taller de econometría. Aunque se registra aparte y tiene horario distinto, la nota del taller se incluye dentro de la nota del curso de econometría I. El enfoque del taller es la aplicación de los temas que se presenta en la clase y ayuda en el manejo de los paquetes estadísticos.

3. Tareas y Exámenes

En el transcurso de semestre se asignará aproximadamente cinco (5) tareas. Los estudiantes pueden trabajar en grupos de dos si prefieren, pero no más de dos por grupo. El estudiante puede escoger el paquete estadístico que quiere usar para elaborar la tarea. El paquete principal del curso será Stata y otros paquetes disponibles incluyen Eviews, Limdep, SPSS, Matlab y Gauss.

En el curso hay dos exámenes parciales y un examen final. El examen final será conjunto con las otras dos secciones de econometría. De esta manera, se espera estandarizar el contenido y el ritmo de los cursos.

4. Textos

El texto principal del material presentado en la clase es:

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

Textos adicionales

Wooldridge, Jeffrey M. (2000), *Introductory Econometrics: a modern approach*, South-Western College Publishing. (W)

Novales, Alfonso (1997), *Econometría*, McGraw Hill, Bogotá

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

William E. Griffiths, R. Carter Hill, George G. Judge (1993), *Learning and Practicing Econometrics*, John Wiley & Sons, New York.

5. Contenido por temas

1. Introducción (Cap. 1 G)
2. Conceptos Básicos de Probabilidad
3. Modelo sencillo y sus supuestos, derivación del modelo (Cap. 3 G)
4. Propiedades estadísticas del modelo sencillo, Guass-Markov (Cap. 3 G)
5. Inferencia estadística, prueba de hipótesis con t , errores tipo I y II, valor p (Cap. 5 G)
6. R^2 , usando escalas (scaling data), formas funcionales (Cap. 6 G)
7. Modelo de regresión múltiple, supuestos revisados (Cap. 7)
8. Parcial 1
9. Modelo múltiple en forma de matrices (Cap. 9 G)
10. Prueba de F , variables omitidos, variables irrelevantes, colinealidad (Cap. 8 G)
11. Maximum likelihood (Cap. 4 y Apendice 4A G), pruebas de Likelihood Ratio, Lagrange y Wald
12. Variables dummy (Cap. 15 G, Cap. 7 W)
13. Multicolinealidad (Cap. 10 G)
14. Parcial 2
15. Heteroscedasticidad (Cap. 11 G)
16. Autocorrección (Cap. 12 G)
17. Random regressors, estimación con variables instrumentales (Cap. 20 G y Cap. 13 HGJ)

18. Econometría de series de tiempo, estacionariedad, raíces unitarias y cointegración (Cap. 21 G)

19. Examen final

6. Evaluación

La nota final de la clase se basa en los exámenes, tareas y la nota final del curso de taller de econometría. Las fechas y porcentajes son los siguientes:

Fechas de exámenes

Parcial 1	septiembre 10
Parcial 2	octubre 29
Examen final	periodo de exámenes

Distribución de notas

Taller de econometría	15%
Tareas	10%
Parcial 1	25%
Parcial 2	25%
Examen Final	25%

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. La Regla de Tres de Coronado: Para pasar el curso, hay que tener un promedio mínimo de 3.00 en los tres exámenes. ¿Quejas? hcoronad@uniandes.edu.co