

**UNIVERSIDAD DE LOS ANDES
FACULTAD DE ECONOMIA**

TALLER DE ECONOMETRIA I

PROGRAMA

Profesor: Jorge Alexander Bonilla
E-mail: jor-boni@uniandes.edu.co

Horario de Clases: Martes 5:00 PM. – 6:55 PM.
Jueves 5:00 PM. – 6:55 PM.

Objetivo

Efectuar estimaciones econométricas (regresión simple y regresión múltiple) manejando bases de datos en paquetes estadísticos. El curso busca aplicar los conceptos teóricos básicos vistos en la clase magistral de *Econometría I*. Los estudiantes desarrollarán talleres con el objeto de adquirir destreza en el manejo de los programas de computador y en el análisis de problemas económicos que requieran ser asistidos con la econometría.

Se usará durante el curso Excel y Stata 8.0. Cada programa de computador tendrá una aplicabilidad específica, tratándose del tipo de estimación. Sin embargo, se enfatizará en la versatilidad de algunos de estos programas para abordar un conjunto de problemas económicos.

Evaluación del curso

Corresponderá al 15% de la nota final de la asignatura "*Econometría I*". Dicha calificación estará relacionada con 4 talleres, donde la solución de cada uno deberá ser entregada ocho (8) días después de recibido el instructivo del taller, y con una evaluación sobre el manejo de los programas de computador. Los talleres podrán ser entregados en grupos de dos estudiantes, mientras las evaluaciones serán individuales.

Bibliografía

Conceptos Teóricos

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

- 2
- 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.

Manejo de los programas de computador

Los estudiantes pueden consultar el menú de ayuda de cada paquete estadístico. Para obtener información adicional se tienen las siguientes direcciones electrónicas:

- <http://www.eviews.com>
- <http://www.stata.com>

Tópicos del Curso

Capítulo 1. Introducción Al Excel

- 1.1. Generación de números aleatorios
- 1.2. La media y la varianza
- 1.3. El diagrama de dispersión
- 1.4. La covarianza entre dos variables
- 1.5. El coeficiente de correlación lineal
- 1.6. La matriz de varianza-covarianza de las variables
- 1.7. La matriz de correlación de las variables
- 1.8. Otras estadísticas descriptivas (mediana, curtosis y asimetría).
- 1.9. Prueba de hipótesis.

Capítulo 2. Introducción A Stata 8.0

- 2.1. Importar bases de datos
- 2.2. Estadísticas descriptivas para las variables
- 2.3. El diagrama de dispersión

- 2.4. Matriz de varianza-covarianza de las variables
- 2.5. Matriz de correlaciones de las variables

Capítulo 3. Regresión Simple En Excel Y Stata 8.0

- 3.1. Estimación de los parámetros del modelo
- 3.2. Varianzas y errores estándar de los estimadores.
- 3.3. Intervalos de confianza
- 3.4. Pruebas de hipótesis

Capítulo 4. Regresión Múltiple En Excel Y Stata 8.0

- 4.1 Estimación de los parámetros del modelo
- 4.2 Matriz de varianzas y covarianzas de los estimadores
- 4.3 Pruebas de hipótesis
- 4.4 Coeficiente de determinación ajustado
- 4.5 Intervalos de confianza

Capítulo 5. Regresión Con Variables *Dummy*

- 5.1. Construcción de variables *dummy*
- 5.2. Estimación del modelo con variable independiente *dummy*.

Capítulo 6. Incumplimiento De Los Supuestos De MCO

- 5.1 Multicolinealidad
- 5.2 Heterocedasticidad
- 5.3 Autocorrelación

Agosto 4 de 2003.