

ECON 2301

Econometría I

2005 Semestre I

Horario: Lunes y Miércoles 11:00 a.m. – 1:00 p.m.

Salón: Z 217

Profesor: Norman Offstein

Correo electrónico: noffstei@uniandes.edu.co

Horas de oficina: Miércoles 9:00 – 11:00 a.m., Oficina 213

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 seis (6) tareas. Los estudiantes pueden trabajar en grupos de DOS (2) 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 la otra sección 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:

Wooldridge, Jeffrey M. (2000), *Introducción a la Econometría: un enfoque moderno*, South-Western College Publishing. (W)

Textos adicionales

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

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 W)
2. Conceptos básicos de probabilidad
3. La regresión sencilla y los supuestos; derivación del modelo (Cap. 2 W)
4. Propiedades estadísticas del modelo lineal sencillo, Gauss-Markov (Cap. 2 W)
5. Regresión múltiple, inferencia, pruebas de hipótesis con la prueba t , errores de tipo I y tipo II, valor p (Cap. 3-4 W)
6. Modelo de regresión múltiple, revisión de los supuestos, variables omitidas, variables irrelevantes, prueba F (Cap. 4 W)
7. Parcial 1
8. R^2 , cambiando la escala de los datos, forma funcional (Cap. 6 W)
9. Regresión múltiple en forma matricial (Cap. 9 G)
10. Verosimilitud máxima (Cap. 4 y Appendix 4A G), Likelihood Ratio, pruebas de Lagrange
11. Variables dummy (Cap. 7 W)
12. Heteroskedasticidad (Cap. 8 W)
13. Problemas de especificación y datos (Cap. 9 W)
14. Parcial 2
15. Series de tiempo, estacionaridad, raíces unitarias y cointegración (Cap. 10 y 11 W)
16. Autocorrelación (Chap. 12 W)
17. 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	febrero 23
Parcial 2	abril 13
Examen final	periodo de exámenes

Distribución de notas

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

Aproximación de notas sería en intervalos 0.25, así una nota de 3.75 se aproxima a 4 y 3.74 a 3.5.