

ECON 2301
Econometría I

Horario: MJ 8:30am-9:50am, M-100

Sección 1 (Soto): I 11:30am-12:50pm (Sala de Cómputo)

Sección 2 (Bohórquez): V 7:00am-8:20am (Sala de Cómputo)

Horario de Atención: Martes y Jueves 11:00am-12:30pm
Bloque C Oficina 310
Email: rbernal@uniandes.edu.co

Descripción:

La econometría es la utilización rigurosa de la estadística para analizar e interpretar datos socioeconómicos. El objetivo principal del curso, por tanto, será el de guiar a los estudiantes en el uso e interpretación de variables económicas y las metodologías básicas diseñadas para analizar las relaciones entre dichas variables. En particular, nos propondremos identificar los problemas más comunes que se enfrentan al analizar datos económicos y las metodologías que se han desarrollado para solucionar dichos inconvenientes.

En suma, nuestros objetivos específicos serán: (1) familiarizar a los estudiantes con el trabajo empírico en economía, la consulta de fuentes de datos y el manejo de datos socioeconómicos, (2) introducir los conceptos y metodologías econométricas básicas para llevar a cabo análisis económico formal y riguroso con base en datos socioeconómicos, (3) familiarizar a los estudiantes con herramientas computacionales básicas para el manejo y análisis de datos, (4) establecer ciertos lineamientos básicos para realizar investigación aplicada en economía y (5) estimular la capacidad de análisis y síntesis y la capacidad crítica de trabajos empíricos.

Algunos de los temas que se incluyen en este curso son: análisis básico de datos, regresión lineal, formas funcionales, heterocedasticidad, correlación serial y predicción.

Textos Guía:

Essentials of Econometrics, Damodar Gujarati (3^a ed.), McGraw-Hill.

Introductory Econometrics, Jeffrey M. Wooldridge (2^a ed.), Thomson.

Metodología y Evaluación:

El curso enfatizará los aspectos empíricos por lo cual se presentarán múltiples ejemplos y aplicaciones reales tanto en la clase magistral como en las clases complementarias. Sin

embargo, es importante que los estudiantes dominen también los aspectos algebraicos y matemáticos presentados en clase. Como complemento a los temas presentados en clase, los estudiantes deberán realizar un taller semanal. Los talleres estarán disponibles cada viernes en la mañana en la página web y deberán ser entregados en la clase del jueves de la semana siguiente sin falta. Sin excepción, no se recibirán tareas después del límite establecido. A la hora de calcular el promedio de talleres, no se tomará en cuenta la nota más baja. Aunque es recomendable trabajar en grupos, cada estudiante debe entregar su propia hoja de respuestas. Para solucionar los ejercicios empíricos de los talleres se requerirá la utilización de Stata. Al final del semestre, los estudiantes deberán también realizar un proyecto final en grupos de dos. En particular, los estudiantes deberán escoger una de varias bases de datos que serán propuestas, plantear una hipótesis con base en los datos disponibles, realizar los ejercicios econométricos necesarios para proveer una respuesta a la hipótesis planteada y escribir un paper corto de no más de 5 páginas a doble espacio (sin incluir tablas y gráficas) que resuma los resultados más importantes del ejercicio.

Evaluación:

Dos exámenes parciales	40% (20% c/u)
Talleres	15%
Quices	8%
Proyecto Final	7%
Examen Final	30%

La nota final se calcula por curva, es decir, de acuerdo a la posición del estudiante en la distribución total del curso. Adicionalmente debe aprobar por lo menos uno de los dos parciales para aprobar el curso. La curva APROXIMADA será así:

%	Nota final
15	5,0
17	4,5
21	4,0
28	3,5
15	3,0
4	<3,0

Fechas:

Primer examen parcial: martes Septiembre 19
 Entrega del 30% de la nota: Septiembre 29
 Ultimo día para retirar la materia: Octubre 13
 Segundo examen parcial: jueves Noviembre 2
 Entrega del proyecto final: martes Noviembre 28 (antes de las 5pm)
 Examen final: Fecha establecida por la Universidad.
 Es importante que agenden esta fecha apenas esté disponible porque no se aplazarán ni pospondrán exámenes bajo ninguna circunstancia.

Programa:

Semanas 1 y 2. **Introducción y repaso estadístico:** Gujarati Capítulos 1-4; Wooldridge Capítulo 1 y Apéndice B.

Semana 3. **Introducción del modelo clásico lineal:** Gujarati Capítulo 6; Wooldridge Capítulo 2.

Semanas 4 y 5a. **Intervalos de Confianza y Pruebas de Hipótesis:** Gujarati Capítulos 5 y 7; Wooldridge Capítulo 4.

Semanas 5b y 6. **Regresiones múltiples y formas funcionales no lineales:** Gujarati Capítulos 8 y 9; Wooldridge Capítulos 3 y 6.

Semana 7a. **Parcial.**

Semana 7b y Semana 8. **Variables binarias (como variables explicativas y variables dependientes) y cambio estructural:** Gujarati Capítulo 10; Wooldridge Capítulo 7.

Semana 9. **Relajando los supuestos del modelo clásico - Multicolinealidad:** Gujarati Capítulo 12.

Semana 10, 11 y 12a. **Heterocedasticidad y Autocorrelación:** Gujarati Capítulo 13-14; Wooldridge Capítulo 8, 10 (Secciones 10.1 y 10.2) y Capítulo 12.

Semana 12b. **Segundo examen parcial.**

Semana 13. **Problemas de especificación:** Gujarati Capítulo 11; Wooldridge Capítulo 9.

Semana 14. **Ecuaciones simultáneas e identificación:** Gujarati Capítulo 15; Wooldridge Capítulo 16.

Semana 15. **Variables instrumentales:** Gujarati Capítulo 15 (2ª parte); Wooldridge Capítulo 15.

Examen Final