

ECON 2301
Econometría 1 – 2007II

Horario: LM 11:30am-12:50pm, Salón R-111
Sección 1 (Bohórquez): J 11:30am-12:50pm, G-103 (Sala Computadores)
Sección 2 (Helo): J 11:30am-12:50pm, LL-304 (Sala Computadores)

Horario de Atención: Lunes y Miércoles 2:00-3:45pm
Bloque E Oficina 108
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, y (4) establecer ciertos lineamientos básicos para realizar investigación aplicada en economía.

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 *jueves* en la página web y deberán ser entregados en la clase del *miércoles* 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 escribir independientemente su propia hoja de respuestas. No se aceptarán talleres si son idénticos (u obviamente muy parecidos) al de otro estudiante. Se llevarán a cabo aproximadamente 6 quices durante el semestre que pueden ser avisados o sorpresa; adicionalmente algunos serán en la clase magistral y otros serán en la clase complementaria. A la hora de calcular el promedio de quices, no se tomará en cuenta la nota más baja. Para solucionar los ejercicios empíricos de los talleres se requerirá la utilización de Stata, por lo cual es fundamental asistir a la clase complementaria.

Evaluación:

Dos exámenes parciales	46% (23% c/u)
Talleres	15%
Quices	9%
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: lunes Septiembre 17
Entrega del 30% de la nota: Septiembre 28
Ultimo día para retirar la materia: Octubre 12
Segundo examen parcial: miércoles Noviembre 7
Examen final: Fecha establecida por la Universidad.

Es importante que agenden estas fechas (incluida la del examen final apenas esté disponible) porque **no** se aplazarán ni pospondrán exámenes bajo ninguna circunstancia.

Programa:

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

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

Semanas 3 y 4. **Intervalos de Confianza y Pruebas de Hipótesis:** Gujarati Capítulos 5 y 7; Wooldridge Capítulo 4.

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

Semana 6. **Variables binarias (como variables explicativas y variables dependientes), primera parte** Gujarati Capítulo 10; Wooldridge Capítulo 7.

Semana 7. **Parcial y corrección de parcial**

Semana 8. **Variables binarias, cambio estructural – segunda parte** Gujarati Capítulo 10; Wooldridge Capítulo 7.

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

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

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

Semana 12. **Autocorrelación y Problemas de especificación.** Gujarati Capítulo 11; Wooldridge Capítulo 9.

Semana 13. **Segundo examen parcial.**

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

Myd:/Uniandes/Teaching/Econ2301