

Horario: 2:00 a 5:00 PM

Salón de Clases: Au-205

Límite de Retiro: Julio 16 5:00PM

Horario Atención: Miércoles 11:00 AM a 1:00 PM - Facultad de Economía

Profesora complementaria:

Mónica Juliana Reyes: mj.reyes68@uniandes.edu.co

Horario Atención: Lunes 4:00 PM a 5:00 PM – W 815

Monitora:

Paula Andrea Beltrán Saavedra: pa.beltran41@uniandes.edu.co

Horario Atención: Coordinará con los estudiantes

1. INTRODUCCIÓN

La econometría es el arte y la ciencia de utilizar teorías económicas y técnicas estadísticas para analizar datos económicos. Como tal, es el instrumento cuantitativo más utilizado en el análisis de las relaciones empíricas entre variables económicas. Este curso presenta los marcos teóricos y operativos básicos de los modelos y métodos econométricos.

2. OBJETIVOS

- Proporcionar a los estudiantes las bases iniciales para el manejo de los modelos y métodos econométricos.
- Familiarizar a los estudiantes sobre la aplicación de modelos que permitan entender el comportamiento de los agentes económicos, como son los individuos, las firmas y el gobierno.
- Suministrar los elementos necesarios para el manejo de la información, análisis de resultados e interpretación de los mismos que hagan más eficiente la labor de investigación económica.

3. COMPETENCIAS A DESARROLLAR

- Tener la capacidad de análisis y síntesis.
- Desarrollar la capacidad crítica.
- Tener la capacidad de consultar fuentes de datos y organizarlos de forma analítica y sintética.
- Tener la capacidad de manejar herramientas computacionales y de programación.
- Empezar a asimilar, apropiar y reproducir un canon de conocimiento en economía.
- Tener habilidad para aplicar el análisis empírico formal a la comprensión de la realidad.
- Apropiarse de los métodos de investigación empírica. Reconocer las posibilidades, diversidad y limitaciones de su aplicación.
- Reconocer el énfasis cuantitativo de la disciplina y mostrar habilidades para su manejo.
- Desarrollar la capacidad de recolectar y/o construir datos.

4. METODOLOGIA

El curso se desarrollará mediante sesiones de clases diarias, en las que se expondrán los conceptos teóricos. Adicionalmente, se presentarán ejemplos ilustrativos y se realizarán ejercicios prácticos en las sesiones complementarias. Por ende, la sesión de taller cuenta con el propósito de cimentar los conceptos teóricos mediante el manejo del instrumental analítico a través del computador con programas como STATA o EVIEWS. De ser necesario, se acordarán algunos días de monitoria.

5. EVALUACIÓN

Parcial 1	20%
Parcial 2	25%
Examen Final	30%
Talleres y quizzes	25%

Reclamos (Artículo 62 y 63 del Reglamento General de Estudiantes de Pregrado)

“Todo estudiante que desee formular un reclamo sobre las calificaciones de cualquier evaluación o sobre la nota definitiva del curso, deberá dirigirlo por escrito y debidamente sustentado al profesor responsable de la materia, dentro de los ocho (8) días hábiles siguientes a aquel en que se dan a conocer las calificaciones en cuestión. El profesor dispone de diez (10) días hábiles para resolver el reclamo formulado; vencido el término informará al estudiante la decisión correspondiente.”

“Si el estudiante considera que la decisión no corresponde a los criterios de evaluación, podrá solicitar la designación de un segundo calificador mediante un escrito debidamente sustentado, dirigido al Consejo de Facultad o de Departamento, según el caso, dentro de los ocho (8) días hábiles siguientes al conocimiento de la decisión. Si el Consejo encuentra fundada la solicitud, procederá a designar, solamente para tal efecto, un segundo calificador cuya decisión debidamente sustentada será definitiva e inmodificable. En ningún caso, el segundo calificador podrá desmejorar la nota inicialmente asignada por el profesor.”

Algunas reglas:

- La convivencia en el salón de clase incluye el mantener los teléfonos celulares apagados durante la sesión de clase.
- Las establecidas en el Reglamento General de Estudiantes de Pregrado.
- Las establecidas en el Reglamento General de Estudiantes de Postgrado.
- Para la entrega de talleres, se debe consultar el documento guía “*formato de entrega talleres*”, disponible en la siguiente página:
http://economia.uniandes.edu.co/profesores/planta/Rosales_Alvarez_Ramon/Econometria_1/DOCUMENTOS_DE_CLASE

6. FECHAS IMPORTANTES

- Primera clase magistral: Julio 3
- Primer parcial: Julio 11
- Segundo parcial: Julio 18
- Última clase magistral: Julio 23
- Examen final: Julio 25

- Fechas de talleres:

Taller	Tema	Fecha Entrega a los estudiantes	Fecha que los estudiantes entregan
Taller 1	Introducción, repaso de probabilidad y estadística.	Viernes, 29 de Junio	Sábado 7 de julio
Taller 2	Regresión Lineal	Jueves 5 de Julio	Sábado 14 de Julio
Taller 3	Regresión Múltiple y Variables Cualitativas	Miércoles 11 de Julio	Sábado 21 de Julio
Taller 4	Taller de Investigación	Viernes 29 de Junio	Miércoles 25 de Julio

7. CONTENIDO

1. INTRODUCCIÓN (Semana 1)

(S&W Parte I, RB, Caps. 1, 2 y 3; GU, Cap. 1; WO, Cap. 1, A&P Caps. 1 y 2)

- 1.1 Introducción a la econometría (Capítulo 1 S&W)
- 1.2 Repaso de Probabilidad (Capítulo 2 S&W)
- 1.3 Repaso de Estadística (Capítulo 3 S&W)

2. REGRESIÓN LINEAL CON UNA VARIABLE (Semanas 1 y 2)

(S&W Capítulo 4, exceptuando la sección 4.7, RB, Cap. 4; GU Caps. 2 a 6; WO, Cap. 2, A&P Cap. 3)

- 2.1 Especificación del modelo
- 2.2 Supuestos del modelo
- 2.3 Método de estimación de mínimos cuadrados (OLS)
- 2.4 Pruebas de hipótesis
- 2.5 Evaluación del modelo
- 2.6 Análisis de los supuestos: heteroscedasticidad

3. REGRESIÓN MÚLTIPLE (Semanas 2 y 3)

(S&W Capítulo 5, RB, Cap. 5; GU, Caps. 7 y 8; WO, Caps. 3 a 6, A&P Cap. 3)

- 3.1 Omisión de variables
- 3.2 Especificación del modelo
- 3.3 Supuestos del modelo
- 3.4 Método de estimación de mínimos cuadrados ordinarios
- 3.5 Distribución de los estimadores
- 3.6 Pruebas de hipótesis conjuntas
- 3.7 Evaluación del modelo
- 3.8 Análisis de los supuestos: multicolinealidad

4. MODELOS CON VARIABLES CUALITATIVAS Y NO LINEALES (Semana 3)

(S&W Sección 4.7, Capítulo 6, GU, Cap. 9; WO, Cap. 7)

- 4.1 Variables binarias (dummies)
- 4.2 Polinomios
- 4.3 Logaritmos
- 4.4 Interacciones

5. INTRODUCCIÓN A LAS VARIABLES INSTRUMENTALES (Semana 4) (S&W Capítulo 10; GU, Caps. 18,19 y 20, WO, Cap. 15, A&P Cap. 4)

- 5.1 Definición
- 5.2 Supuestos
- 5.3 Estimación (2SLS)
- 5.4 Estimador
- 5.5 Ejemplos

8. BIBLIOGRAFIA

El libro de referencia principal para la clase será:

- **Stock, James H. y Mark W. Watson.** *Introducción a la Econometría*. 2003. Primera Edición. Adison Wesley.

Este libro está disponible tanto en español como en inglés. También existe una segunda edición. Dado que el material que vamos a ver es bastante estándar, más que el libro como tal, lo importante es que sigan la organización del material sugerida en el contenido.

En caso de no ser posible conseguir este libro en particular, y para los estudiantes que desean una presentación alternativa del material, también pueden consultar:

- **Angrist, Joshua D. y Jorn-Steffen Pischke.** *Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion*. 2009. Princeton University Press. (A&P)
- **Gujarati, Damodar N.** *Econometría*. 2004. Cuarta Edición. Mc Graw Hill. (GU)
- **Rosales Ramón y Bonilla Jorge.** 2006. *Introducción a la Econometría*. Apuntes de Clase No. 3. CEDE. Facultad de Economía. Universidad de los Andes. (RB) Disponible: http://economia.uniandes.edu.co/profesores/planta/Rosales_Alvarez_Ramon/Econometria_1/DOCUMENTOS_DE_CLASE
- **Wooldridge, Jeffrey M.** *Introducción a la Econometría*. 2002. Segunda Edición Thomson Learning. (WO)

Fecha de entrega del 30% de las notas: Julio 13 de 2012

Fecha límite para retiros: Julio 16 de 2012