

1. Horario atención a estudiantes, correos electrónicos, nombres de los profesores complementarios y monitores

Clase magistral

Profesor: Ramón Rosales (rrosales@uniandes.edu.co)

Atención a estudiantes: Acordar por correo.

Horario Clase: Martes, miércoles y jueves 14:00 – 16:50 p.m.

Salón: W-504

Clase complementaria

Profesor: Andrés Felipe Camacho (af.camacho1169@uniandes.edu.co)

Atención a estudiantes: miércoles de 10 a 11 en W-826, o acordar por correo.

Horario Clase: Viernes, 14:00 – 16:50 p.m.

Salón: ML-207

Monitores

Monitora: Sofía Castro Vargas (s.castro15@uniandes.edu.co)

Atención a estudiantes: jueves de 12:00 – 1:00 p.m., preferiblemente acordar por correo.

2. Introducción y descripción general del curso

Desde el punto de vista investigativo, los postulados y teorías económicas son evaluadas y probadas empíricamente usando datos de los agentes económicos o del mercado. La econometría es el instrumento cuantitativo más utilizado para analizar las relaciones empíricas entre las variables económicas que sugiere la teoría. El curso presenta el marco teórico y operativo básico de los modelos y los métodos econométricos. Los alumnos estudiarán los modelos de regresión lineal simple y múltiple, analizando sus supuestos, sus aplicaciones y sus limitaciones. Adicionalmente los estudiantes trabajarán en una idea simple de investigación que les permitirá aplicar la teoría e implementar las herramientas empíricas para probar hipótesis.

Econometría 1 es la parte introductoria de los cursos del área de econometría. Cursos posteriores incluyen Econometría 2 y Econometría Avanzada. Econometría 1 es también un curso del Ciclo Común de Formación Básica y se ofrece en el cuarto semestre de la carrera de economía. Se espera que los estudiantes hagan uso frecuente de los conceptos de probabilidad y estadística, álgebra lineal y cálculo diferencial e integral vistos previamente, así como de la teoría económica.

3. Objetivos de la materia

- Proporcionar a los estudiantes las bases iniciales para el manejo de los modelos y métodos econométricos.

- Familiarizar a los estudiantes con la aplicación de modelos que permitan entender el comportamiento de los agentes económicos, y con la estimación de parámetros para el análisis y evaluación de medidas de política.
- Suministrar los elementos necesarios para el manejo de la información, prueba de hipótesis, análisis de resultados e interpretación de salidas del computador que hagan más eficiente la labor de investigación económica.

4. Organización del curso: Contenido

CAPÍTULO 1. INTRODUCCIÓN (*RB, caps. 1, 2 y 3; HGJ, cap. 1; GU, cap. 1; WO, cap. 1; KE, cap. 1; SW, caps. 1,2 y 3*)

- 1.1 Definición de econometría
- 1.2 Modelo económico y modelo econométrico
- 1.3 Elementos de los modelos econométricos
- 1.4 Tipos de datos y de variables
- 1.5 Breve revisión de las estadísticas

CAPÍTULO 2. REGRESIONES MCO MINIMOS CUADRADOS ORDINARIOS (*RB, caps. 4 y 5; GU, caps. 2 a 8; WO, cap. 2 a 6; HGJ, caps. 3 a 8, SW, caps. 4 a 8*)

- 2.1 Análisis de correlación y pruebas de hipótesis
- 2.2 Objetivo del análisis de regresión
- 2.3 Especificación del modelo
- 2.4 Estimación de los coeficientes por MCO en una regresión simple
- 2.5 Modelo de regresión lineal múltiple
- 2.6 Variables explicativas binarias
- 2.7 Supuestos del modelo
- 2.8 Pruebas de hipótesis
- 2.9 Varianza de los estimadores MCO
- 2.10 Pruebas de Hipótesis
- 2.11 Bondad del Ajuste, R^2 ajustado, Intervalos de Confianza
- 2.12 Expresión del modelo en forma matricial
- 2.13 Regresión no lineal y con interacción
- 2.14 El Modelo Logarítmico, cálculo de elasticidad
- 2.15 Modelo con restricciones lineales
- 2.16 Significación global del Modelo, estadístico F

CAPÍTULO 3. MODELOS CON VARIABLES CUALITATIVAS O FICTICIAS (*GU, cap. 9; WO, cap. 7; HGJ, cap. 9*)

- 3.1 Naturaleza de las variables cualitativas
- 3.2 Modelos con variables independientes cualitativas
- 3.3 Cambio estructural
- 3.4 Modelos de probabilidad: mpl, logit y probit

CAPÍTULO 4. MULTICOLINEALIDAD (*GU, cap. 10; WO, cap. 3; HGJ, cap. 8*)

- 4.1 Definición
- 4.2 Naturaleza
- 4.3 Consecuencias
- 4.4 Métodos para detectar el problema
- 4.5 Métodos para corregir el problema

CAPÍTULO 5. HETEROSCEDASTICIDAD (*GU, cap. 11; WO, cap. 8; HGJ, cap. 11; JGLGL, cap. 6; JD, cap. 6*)

- 5.1 Definición

- 5.2 Naturaleza
- 5.3 Consecuencias
- 5.4 Métodos para detectar el problema
- 5.5 Métodos para corregir el problema
- 5.6 Mínimos cuadrados ponderados

CAPÍTULO 6. AUTOCORRELACIÓN (GU, cap. 12; HGJ, cap. 12; JGLGL, cap. 6)

- 6.1 Definición
- 6.2 Naturaleza
- 6.3 Consecuencias
- 6.4 Métodos para detectar el problema
- 6.5 Métodos para corregir el problema
- 6.6 Mínimos cuadrados generalizados

CAPÍTULO 7. SESGO DE ESPECIFICACIÓN Y NO NORMALIDAD DE LOS ERRORES

(GU, cap. 13; WO, cap. 9)

- 7.1 Sesgo de especificación
- 7.2 No normalidad de los errores

5. Metodología

La clase magistral:

El curso se desarrollará mediante tres sesiones de clases semanales, en las que se expondrán los conceptos teóricos, con ejemplos ilustrativos y la realización de ejercicios en clase y tareas. El profesor magistral en las clases distribuirá material impreso (ejercicios en clase y/o salidas de computador) para fortalecer el aprendizaje de la teoría. Será común el uso del tablero. Se invita a los estudiantes a participar en clase, para ello el profesor continuamente efectuará preguntas de comprensión y análisis. Se sugiere a los estudiantes leer con anterioridad los temas de clase usando la lista de referencias presentadas en cada capítulo.

El profesor cuenta con un horario de atención para resolver dudas del curso o recibir comentarios, el cual se presenta al inicio del programa del curso. Con el objeto de organizar la atención a estudiantes, la atención se efectuará con base en cita previa, enviando un correo electrónico a más tardar el día anterior de la fecha de atención.

La clase complementaria:

El curso cuenta con sesión de taller con el propósito de cimentar los conceptos teóricos mediante el manejo del instrumental analítico a través del computador. En cada capítulo se interpretarán salidas de computador (STATA y EXCEL) relacionados con los temas vistos. El profesor complementario también cuenta con un horario de atención para resolver dudas del curso o recibir comentarios (ver horario al inicio del programa del curso). Por motivos de organización, la atención se efectuará también con base en cita previa en los casos en los que la consulta deba hacerse por fuera de los horarios de atención respectivos, enviando un correo electrónico a más tardar el día anterior de la fecha de atención. Se recomienda consultar con el complementario en la clase y en el horario de atención las dudas sobre los talleres con suficiente tiempo antes de la fecha de entrega.

Monitoría:

Adicionalmente, se acordarán algunos días de monitoría previos al primer y segundo parcial. Las monitorías tienen como fin último el repaso de los temas vistos en el curso con base en la solución de ejercicios tipo parcial. Los monitores también cuentan con un horario de atención para resolver dudas del curso o recibir comentarios (ver horario al inicio del programa del curso).

Dinámicas pedagógicas adicionales:

En el transcurso del curso se realizarán quices en las clases magistral y complementaria sin previo aviso. Los quices evaluarán temas generales de la clase, talleres o tareas. Adicionalmente, en la clase complementaria se realizarán bonos de participación que se sumaran a la nota de talleres.

También se asignarán talleres de trabajo teórico y aplicado, requiriendo el uso de software estadístico. Se realizarán en total cinco talleres. Los primeros cuatro tendrán una parte teórica y otra práctica. Para la realización del taller es necesario seguir los lineamientos del *"Instructivo para la entrega de talleres"*, archivo que pueden descargar de la página de SicuaPlus del curso.

Se les recuerda a los estudiantes que deben tener presente los horarios de atención del profesor magistral y del complementario, que están al inicio del presente programa. Para cualquier horario adicional sobre temas y dudas que no pueden resolverse por correo, deberá coordinarse con el respectivo profesor y está sujeto a su disponibilidad de tiempo.

Taller 5: Investigación:

En el quinto taller los estudiantes desarrollarán una idea simple de investigación en la que se busca probar alguna hipótesis interesante sobre un tema particular. Los detalles del objetivo y cómo presentar este documento se encuentran en *"Formato Taller de Investigación – Taller 5"*. El taller de investigación tendrá 3 entregas y una presentación final, en búsqueda de que los estudiantes se familiaricen con la labor investigativa y su presentación. Se hará énfasis en la revisión de literatura, y en el tratamiento y análisis de datos.

Las tres entregas del taller 5 serán en las mismas parejas al igual que la **presentación. La entrega final es requisito para realizar la presentación.** Las presentaciones durarán 10 minutos y todos los integrantes deben presentar. Finalmente, las instrucciones detalladas y las fechas de las presentaciones se enviarán en el transcurso del curso.

Nota: Todos los talleres, incluyendo el de investigación, deberán hacerse en grupos de máximo tres personas. Es responsabilidad del estudiante conformar su grupo en la primera semana de clases. Cualquier eventualidad o complicación con respecto a lo anterior, deberá ser consultada con el respectivo profesor complementario.

6. 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 simplificadora.
- Tener la capacidad de manejar herramientas computacionales y de programar.
- Asimilar, apropiar y reproducir un canon de conocimiento en economía.
- Tener habilidad para aplicar el análisis 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 el manejo cuantitativo. Desarrollar la capacidad de recolectar y/o construir datos.

7. Criterios de evaluación

Parcial 1	30%
Parcial 2	30%
Talleres 1 al 4:	16% (4% cada uno)
Taller 5:	16% (entrega 1: 3%; entrega 2: 3%; entrega final: 5%; presentación 5%)
Actividades clase complementaria:	8%

8. Sistema de aproximación de notas definitivas

Dando alcance a la modificación al sistema de calificaciones, el Comité Directivo, en la sesión No. 72-13 del 19 de junio de 2013, aprobó la siguiente escala de calificaciones, incluida en el art. 51 del Reglamento General de Estudiantes de Pregrado (RGEPr), el art. 49 del Reglamento General de Estudiantes de Especialización (RGEE), el art. 51 del Reglamento General de Estudiantes de Maestría (RGEMa), y el art. 61 del Reglamento General de Estudiantes de Doctorado (RGED): “Las calificaciones definitivas de las materias serán numéricas de uno cinco (1,50) a cinco (5,00), en unidades, décimas y centésimas. La calificación aprobatoria mínima será de tres (3,00).”

REGLA PARA LA NOTA FINAL

La nota final del curso será aproximada a los siguientes dos dígitos decimales más cercanos (si la nota resulta ser 3.625, la nota final será 3.63). El estudiante solo podrá aprobar el curso si aprueba alguno de los dos parciales, o el examen final. **Si el estudiante no logra pasar ninguno de los 3 exámenes, la nota final en Banner será máximo 2.99.**

Algunas reglas:

- El respeto y la honestidad entre estudiantes y profesores son la base fundamental de una dinámica armónica del curso.
- La convivencia en el salón de clase incluye el mantener los teléfonos celulares apagados durante la clase.
- Cualquier copia o intento de copia tendrá la sanción correspondiente según el Comité Disciplinario de la Facultad de Economía.
- Se utilizará SicuaPlus (<https://sicuaplus.uniandes.edu.co/>) para la difusión de cualquier información. Todo el material de la clase (programa, diapositivas, talleres, y otros) estarán disponibles en la sección de contenidos del curso magistral “ECONOMETRIA 1” de SicuaPlus.
- En cada taller, toda la parte práctica y todo lo que se haya hecho a computador deberá ser subido a SicuaPlus en los links habilitados para ello.
- Las establecidas en el Reglamento General de Estudiantes de Pregrado.
- Las establecidas en el Reglamento General de Estudiantes de Postgrado.
- Los talleres se realizarán en grupos de máximo dos personas. Todos los integrantes del grupo deben participar activamente en la solución del taller. Si desafortunadamente su compañero de taller retira la materia, busque rápidamente otro compañero de taller, de lo contrario usted deberá entregar el taller individualmente.
- Los talleres serán evaluados según las instrucciones estipuladas en el “*Instructivo para la entrega de talleres*”, y “*Formato Taller de Investigación*” disponibles en SicuaPlus. Los talleres deben ser entregados en la fecha, hora, y casillero especificado.
- Si el estudiante no asiste a una evaluación, solo se considerarán como excusas válidas las estipuladas en el artículo 43 del reglamento de estudiantes. El estudiante hará llegar a la brevedad posible y dentro de los plazos establecidos por el reglamento de la universidad, la excusa al profesor.

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.”

Los reclamos serán válidos siempre y cuando el quiz, el parcial o el examen final hayan sido resueltos en esfero. Para las evaluaciones resueltas a lápiz, el reclamo se debe presentar en el momento en que las pruebas se entreguen calificadas.

Fechas importantes:

- Inicio de clases: martes 5 de junio
- Entrega taller 1: Martes 12 de junio
- Primera entrega taller de investigación:
- Entrega taller 2: Martes 19 de junio
- **Primer parcial: Miércoles 20 de junio**
- Segunda entrega taller de investigación:
- Entrega taller 3: Martes 26 de junio
- **Segundo parcial: Jueves 5 de julio**
- Último día de clases: viernes 6 de julio
- Entrega taller 4: Martes 3 de julio
- Presentaciones proyecto de investigación: viernes 6 de julio
- Entrega documento final de investigación: lunes 9 de julio por SICUAPLUS

9. Bibliografía

Conceptos y Aplicaciones

- **Griffiths, W.E.; R.C. Hill; G. Judge.** 1993. Learning and Practicing Econometrics. John Wiley and Sons. New York. **(GHJ)**
- **Gujarati, Damodar. Porter, Dawn C.** 5th Edicion. 2010. Econometría. Mc Graw Hill. **(GU)**
- **Hill R. Carter; W. E. Griffiths and G. Judge.** 2001. Undergraduate Econometrics. 2ed. Johnson Wiley and Sons. New York. **(HGJ)**
- **Judge, G; W, Griffiths; H, Lutkepohl; R, Carter; T, Lee.** 1998. Introduction to the Theory and Practice of Econometrics. **(JGLCL)**
- **Johnston, J and J. Dinardo.** 1997. Econometrics Methods. Mc Graw Hill. **(JD)**
- **Kennedy, P.** 1998. A Guide to Econometrics. MIT Press. **(KE)**
- **Rosales, Ramón y Bonilla, Jorge.** 2006. Introducción a la Econometría. Apuntes de Clase No. 3. CEDE. Facultad de Economía. Universidad de los Andes. **(RB)**
- **Stock, J and Watson, Mark.** 2003. Introduction to Econometrics. Addison Wesley. **(SW).**
- **Wooldridge, Jeffrey M.** 2010. Introducción a la Econometría. Un efoque Moderno, 4^a. edición. Cengage Learning. **(WO).** (Existe una versión reciente de este libro en inglés:

Wooldridge, Jeffrey M. 2013. Introductory Econometrics: A Modern Approach, 5th Edition. Cengage Learning).

Uso de Stata

- **Baum, Christopher.** 2006. An Introduction to Modern Econometrics Using Stata. Stata Press.
- **Cameron, A. Colin and Trivedi, Pravin K.** 2009. Microeconometrics Using Stata. Stata Press.