

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

Clase magistral

Profesor: Mateo Arbeláez: mateoa2@illinois.edu

Horario de atención a estudiantes: miércoles de 4 a 5 pm

Lugar de atención a estudiantes: Ecomami

Profesor complementario: Daniel Gamboa: d.gamboa2654@uniandes.edu.co

Horario de atención a estudiantes: jueves de 4 a 5 pm

Lugar de atención a estudiantes: W826

Monitor: Nicolás Urdaneta: n.urdaneta@uniandes.edu.co

Horario de atención a estudiantes: viernes de 10 a 11:30 am

Lugar de atención a estudiantes: W-705

2. Introducción y descripción general del curso

Econometría 2 es una clase que busca ofrecer las herramientas estadísticas mínimas para hacer estudios económicos de forma empírica. La clase está dividida en tres partes: corte transversal, series de tiempo, y datos panel. En la clase magistral se va a cubrir la parte teórica del curso, y en la clase complementaria estudiarán la implementación de la teoría en Stata. Todas las semanas habrá un taller que los estudiantes deben resolver en grupos de máximo tres personas. El taller lo deberán entregar en la clase complementaria. El último taller lo deben entregar el día del examen final. Adicionalmente habrá dos trabajos finales y dos exámenes.

3. Objetivos de la materia

El objetivo principal de Econometría 2 consiste en enseñarles a los estudiantes las herramientas básicas que necesitarán cuando vayan a hacer algún análisis empírico. Al finalizar la clase, los estudiantes podrán hacer estudios econométricos sencillos en cualquier área de la economía. Específicamente, podrán hacer estudios con datos de corte transversal en los que sabrán lidiar con los problemas típicos de endogeneidad. En estudios de series de tiempo podrán hacer predicciones de información que no está disponible al público. Además, podrán incorporar variación temporal en los análisis microeconómicos y sabrán en qué momento utilizar efectos fijos, o efectos aleatorios.

4. Organización del curso

a. Corte transversal

i. Endogeneidad

- ii. Solución al problema de endogeneidad
- iii. Modelos de elección binaria
- b. Series de tiempo**
 - i. Modelos univariados de predicción
 - ii. Modelos de múltiples variables
- c. Panel**
 - i. Efectos fijos y efectos aleatorios

5. Criterios de evaluación (Porcentajes de cada evaluación)

- a. Trabajo final series de tiempo:** en julio 6 de 2018 será pública la tasa de desempleo de Estados Unidos para el mes de junio. Su objetivo es hacer una predicción del dato real. Para esto debe presentar un documento de máximo 2 páginas en el que argumente cómo hizo la predicción. Para esto puede utilizar cualquier fuente de información, y los modelos vistos en clase. La nota de este proyecto equivale al 10% de la nota final y será dividida de la siguiente manera: 50% argumentación del modelo que utilizaron, 30% cercanía entre la predicción y el dato real, y 20% forma. Fecha de entrega es julio 5, la última clase magistral. Grupos de máximo 3 personas.
- b. Trabajo final de corte transversal/panel:** Debe entregar máximo dos páginas presentando una propuesta de investigación. En este documento debe ser claro qué pregunta van a responder con la investigación, qué metodología utilizarían en caso de desarrollar la investigación, y una descripción de la base de datos. Es decir, deben decir exactamente qué variables utilizarían, cuántas observaciones tiene cada variable y su disponibilidad. El valor de esta entrega en la nota final es 10%. La nota de esta entrega se parte en: 25% contextualización y relevancia de la pregunta, 25% relevancia del modelo econométrico, 30% presentación de la base de datos, 20% forma. Sería ideal que tuviera la base de datos. La fecha de entrega es el último día de clase. Grupos máximos de 3 personas.
- c. Exámenes:** En este curso habrá dos exámenes, uno parcial que se realizará el 23 de junio de 9 a 11:50, y un examen final (que cubrirá todo el material visto en clase) que será realizado en una fecha asignada por registro uniandes. Cada examen vale el 30% de la materia.
- d. Talleres:** Cada semana habrá un taller que deberán resolver en grupos de máximo 3 personas. Éstos tendrán dos partes: una teórica y una práctica. Los talleres deberán ser entregados en la clase complementaria respectiva, excepto el último que deberán entregar el día del examen final. El total de los talleres vale el 10% de la nota final. Por facilidad de calificación, el equipo de Econometría 2 sólo va a calificar una pregunta aleatoria de los talleres, es decir hagan todo el taller bien. Al final del curso se eliminará la peor nota de taller.
- e. Quices:** Al principio de la clase complementaria los estudiantes deberán presentar un quiz basado en el taller. La nota de todos los quices vale el 10%. Al final del curso se eliminará la peor nota de quiz.

6. Sistema de aproximación de notas definitiva

Las notas se aproximarán a centésimas.

7. Bibliografía

Greene, W. H. (2003). *Econometric analysis*, 5th. Ed.. Upper Saddle River, NJ, 89-140.

Hamilton, J. D. (1994). *Time series analysis* (Vol. 2). Princeton: Princeton university press.

Hayashi, F. (2000). *Econometrics*. Princeton. New Jersey, USA: Princeton University.

Rosales, R. P. C. y Urrego, A.(2010), Fundamentos de econometría intermedia: teoría y aplicaciones. CEDE (Centro de Estudios Sobre Desarrollo Económico), Facultad de Economía, Universidad de los Andes.

Wooldridge, J. M. (2010). *Econometric analysis of cross section and panel data*. MIT press.