

Econometría I

Licenciatura en Economía
Centro de Estudios Económicos
EL COLEGIO DE MÉXICO
Otoño 2016

VERSIÓN PRELIMINAR – FAVOR DE NO DISTRIBUIR

Profesora: Sinaia Urrusti Frenk
Cubículo: 4473
Teléfono: 5449-3000 ext. 4073
Correo: urrusti@colmex.mx

Horario de clases: lunes 4:00-7:00 p.m.
Lugar clase: salón por definirse
Horario de oficina: con cita

Laboratorista: Víctor Delgado Barrera
Correo: vhdelgado@colmex.mx

Horario de laboratorio: por definirse
Lugar laboratorio: salón por definirse

Introducción

Econometría I es un curso introductorio de econometría para los estudiantes del quinto semestre de la Licenciatura en Economía. La clase se enfocará en la parte teórica y los laboratorios en la parte práctica, utilizando el *software* de Stata. Se asume que los estudiantes han cursado y aprobado materias introductorias de micro y macroeconomía, de matemáticas (en particular, cálculo), de probabilidad y de estadística, y que dominan el idioma inglés.

Objetivos

Los objetivos del curso son los siguientes:

1. Entender los principios, conceptos y teorías económicas básicas que sustentan el análisis econométrico actual.
2. Conocer las herramientas, técnicas y métodos para diversas preguntas empíricas en economía.
3. Aprender a analizar datos utilizando aplicaciones computacionales.
4. Evaluar metodologías y resultados básicos de investigaciones empíricas en economía.
5. Estimular el interés en el tema de econometría.
6. Promover un ambiente colaborativo en la clase.

Libros de texto

Los principales libros de texto del curso son:

1. (HGL) Hill, R.C., W.E. Griffiths, and G.C. Lim (2012). *Principles of Econometrics*, 4th Edition, John Wiley & Sons, Inc.
2. (HA) Hill, R.C. and L.C. Adkins (2012). *Using Stata for Principles of Econometrics*, 4th Edition, John Wiley & Sons, Inc.

Otros libros recomendados:

Wooldridge, J. (2008). *Introductory Econometrics: A Modern Approach*, 4th Edition, South-Western College Pub.

Stock, J.H. and M.W., Watson (2010). *Introduction to Econometrics*, 3rd Edition, Addison-Wesley.

Gujarati, D. (2002). *Basic Econometrics*, 4th Edition, McGraw Hill.

Angrist, J.D. and J.S. Pischke (2015). *Mastering Metrics*, Princeton University Press.

Plan del curso

Semana 1 (08/08): Introducción a la econometría

- Clase: HGL capítulo 1
- Laboratorio: HA capítulo 1

Semana 2 (15/08): El modelo de regresión lineal simple

- Clase: HGL capítulo 2
- Laboratorio: HA capítulo 2

Semana 3 (22/08): Estimación de intervalos y comprobación de hipótesis

- Clase: HGL capítulo 3
- Laboratorio: HA capítulo 3

Semana 4 (29/08): Predicción, bondad de ajuste y modelaje

- Clase: HGL capítulo 4
- Laboratorio: HA capítulo 4

Semana 5 (05/09): *Primer examen parcial*

Semana 6 (12/09): El modelo de regresión múltiple

- Clase: HGL capítulo 5
- Laboratorio: HA capítulo 5

Semana 7 (19/09): Inferencia en el modelo de regresión múltiple

- Clase: HGL capítulo 6
- Laboratorio: HA capítulo 6

Semana 8 (26/09): Variables indicadoras

- Clase: HGL capítulo 7
- Laboratorio: HA capítulo 7

Semana 9 (03/10): Heterocedasticidad

- Clase: HGL capítulo 8
- Laboratorio: HA capítulo 8

Semana 10 (10/10): *Segundo examen parcial*

Semana 11 (17/10): Regresión con series de tiempo: variables estacionarias

- Clase: HGL capítulo 9
- Laboratorio: HA capítulo 9

Semana 12 (24/10): Regresores aleatorios y estimación basada en momentos

- Clase: HGL capítulo 10
- Laboratorio: HA capítulo 10

Semana 13 (31/10): Modelos de ecuaciones simultáneas

- Clase: HGL capítulo 11
- Laboratorio: HA capítulo 11

Semana 14 (07/11): Regresión con series de tiempo: variables no estacionarias

- Clase: HGL capítulo 12
- Laboratorio: HA capítulo 12

Semana 15 (14/11): Modelos de datos panel

- Clase: HGL capítulo 15
- Laboratorio: HA capítulo 15

--- 21/11: ASUETO OFICIAL ---

Evaluación

Tareas (10%)

Habrán varias tareas a lo largo del curso que cubrirán material teórico y empírico. Algunas tareas se enfocarán al análisis de datos y requerirán del uso de STATA. Todas las tareas se resolverán en equipo o parejas (dependiendo del número de estudiantes).

Participación (5%)

Buena participación en clase consiste en involucrarse en discusiones de manera informada e inteligente y colaborar en las actividades del curso. Obviamente, deben asistir a clase para poder participar.

Primer examen parcial (25%)

Fecha tentativa: 5 de septiembre

Segundo examen parcial (25%)

Fecha tentativa: 10 de octubre

Examen final (35%)

Fecha por definirse. El examen final cubrirá todo el material del curso.

Notas:

1. No habrá tolerancia para la deshonestidad académica, incluyendo el plagio. Si hacen trampa, reprobarán el curso.
2. No se aceptarán tareas entregadas fuera de tiempo. Todas las entregas se harán de forma impresa, durante la clase en que están programadas (ver la sección “Plan del curso” de este temario).

Información adicional

- Me comunicaré con ustedes a través del sitio del curso y/o vía correo electrónico. Es su responsabilidad revisar ambos medios frecuentemente para estar al tanto del curso.
- Si tienen cualquier duda o comentario, pueden verme en mi cubículo con cita previa o enviarme un correo electrónico, el cual contestaré dentro de 48 horas.
- Los estudiantes que requieran de algún arreglo o concesión especial durante el curso, deben informarme lo antes posible.