

EL COLEGIO DE MÉXICO
Centro de Estudios Económicos
Econometría II
Primavera 2021

Profesora: Aurora Alejandra Ramírez Álvarez

E-mail: aurora_ramirez_alvarez@alumni.brown.edu

Clases serán vía TEAMS

Horas de oficina: mediante cita con la profesora

Horario: martes y jueves de 10 am a 11:30 am.

El objetivo es proporcionar a los alumnos los principios teóricos y prácticos de Econometría II. Se cubrirán temas como el análisis de regresión con datos de series de tiempo, métodos para datos panel, estimación usando variables instrumentales y modelos de variables dependientes limitadas.

Sitio web del curso

Todos los materiales y avisos de la clase se publicarán en el sitio web del curso el cual se puede acceder a través de la biblioteca en la siguiente dirección: <http://biblio-dcv.colmex.mx/>. El acceso a los artículos y al sitio está restringido a los participantes del curso. Para acceder es necesario que utilicen su nombre de usuario y contraseña de El Colegio de México.

Laboratorio

Luis Enrique Santiago Ayala será el laboratorista del curso. En los laboratorios se reforzará la parte práctica de los temas teóricos cubiertos en el curso y se profundizará sobre el material de la clase, se resolverán tareas y se aclararán dudas.

Libro de texto:

Wooldridge, Jeffrey M. (2016, 2020). “Introductory Econometrics: A Modern Approach”, 7th Edition, South-Western CENGAGE Learning.

Horas de oficina y citas

Para resolver dudas sobre la clase o tareas se debe agendar una cita previa con la profesora.

Forma de evaluación del curso

Tareas (20%)

Exámenes sorpresa y participación en clase (10%)

Dos exámenes parciales (20% cada uno)

Examen final (30%)

Tareas

A lo largo del curso se resolverán tareas que serán publicadas en el sitio web del curso dentro de la liga “Tareas.” Junto con cada tarea se publicará la fecha límite de entrega de dicha tarea. Bajo ninguna circunstancia se aceptarán tareas entregadas de forma extemporánea.

Colaboración

Las tareas pueden trabajarse en equipo. Sin embargo, cada quien debe escribir y entregar sus propias respuestas. En conclusión, las tareas se entregan de manera individual.

Temario

No.	Tema	Cap. Wooldridge
1	Breve Repaso Modelo de Regresión Lineal	2 al 8
2	Problemas de especificación y de datos	9
3	Análisis de regresión básico con datos de series de tiempo	10
4	Otros problemas en el uso de OLS con datos de series de tiempo	11
5	Temas avanzados de series de tiempo	18
6	Correlación serial y heterocedasticidad en series de tiempo	12
7	Combinación de secciones transversales en el tiempo: datos de panel simples	13
8	Métodos avanzados de datos de panel	14
9	Estimación de variables instrumentales y mínimos cuadrados de dos etapas	15
10	Modelos de ecuaciones simultáneas	16
11	Modelos de variables dependientes limitadas y correcciones de selección de muestras	17