

Econometría I

Esteban Puentes
epuentes@econ.uchile.cl

Otoño 2011

Ayudantes:

Federico Huneus e-mail: fhuneus@fen.uchile.cl

Diego Vera e-mail : dvera@fen.uchile.cl

Horario y sala de clases: Martes y Jueves 9:45 a 11:45 sala P-304.

1. Descripción del curso

El objetivo principal de este curso es que los alumnos aprendan teoría econométrica a un nivel superior y sean capaces de realizar estudios econométricos aplicados, especialmente de microeconometría, con datos reales. Los objetivos específicos incluyen que el alumno sea capaz de modelar un problema económico como problema estadístico, determinar la estrategia de identificación y sus amenazas, con el objeto de estimar, predecir y testear hipótesis.

A partir de un enfoque teórico y práctico se espera incrementar el acervo de conocimientos estadísticos y econométricos asimilados en curso de pregrado. Este curso requiere un conocimiento mínimo de probabilidades y estadística.

Se requiere el uso de software estadísticos como STATA, MATLAB, GAUSS y R.

2. Contenidos

El curso contempla los siguientes tópicos que podrán sufrir algunas modificaciones menores:

1. Modelo de regresión lineal
2. Elementos de Teoría Asintótica
3. Problemas de Especificación y Datos
4. Modelos de ecuaciones simultáneas
5. Selección en No observables: Endogeneidad
6. Técnicas de re-muestreo y errores estándar
7. Máxima Verosimilitud
8. Variable dependiente limitada

3. Evaluaciones

Los contenidos del curso serán evaluados a través de tareas (de carácter estrictamente individual), una solemne y controles cada dos semanas (aproximadamente).

La evaluación contempla las siguientes ponderaciones:

Tareas (25%): se realizarán 4 o 5 tareas.

Controles (15%)

Solemne (25%)

Examen (35%)

En caso que el alumno por motivos de fuerza mayor u opción propia no entregue una tarea (en forma justificada o no justificada) obtendrá una nota 1.0. Se eliminará el control con la nota más baja.

4. Condiciones del curso

1. La nota de corte para la aprobación del curso será determinada por el profesor.
2. Todo alumno cuya nota final de presentación sea menor que la nota de corte está REPROBADO.
3. Los alumnos tienen 5 días hábiles posteriores a la entrega de sus calificaciones para realizar reclamos. Dichos reclamos deben ser enviados vía email al profesor.

5. Calendario

Martes 17 de Mayo: Prueba Solemne

Examen final, fecha a determinar por la Escuela de Graduados

6. Referencias Bibliográficas

Wooldridge, J., *Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data*, The MIT Press, 2002.

Greene, W., *Econometric Analysis*, Prentice Hall, 6ta. Edición, 2008.

Cameron, C. y Trivedi, P., *Microeconometrics, methods and applications*, Cambridge University Press, 2005.