

Diplomado Banco Central de Honduras
Instituto de Economía
Pontificia Universidad Católica de Chile

Programa de Curso
Econometría

Profesor: Juan Urquiza (jurquiza@uc.cl)
Ayudante: Valentina Andrade (vandrade@uc.cl)

Descripción del curso:

En este curso estudiaremos cómo evaluar hipótesis económicas usando datos. Se estudiará el modelo de regresión lineal como una estimación de la esperanza condicional y sus propiedades.

Notas de clase:

Serán publicadas en el sitio web del curso antes de cada clase. Se espera que los alumnos tengan disponibles estas notas durante las clases.

Bibliografía:

Wooldridge, J. (2015), Introducción a la Econometría: Un Enfoque Moderno. Cengage Learning, 5ta edición.

Aspectos administrativos:

El curso supone un nivel de estadística y álgebra lineal equivalente al que se presenta en los apéndices B, C y D del texto de Wooldridge. También pueden encontrar material de apoyo en el sitio web del curso.

El curso tendrá una duración de 18 horas, distribuidas en 6 clases de 3 horas cada una. Para más información respecto de las horas de clase y ayudantía, por favor revisar el cronograma adjunto.

Las clases serán a través de la plataforma Zoom, usando el siguiente link:

<https://zoom.us/j/92744480730?pwd=U1FlckhGNE5lZmhvdW50dVNQTjk0UT09>

Meeting ID: 927 4448 0730
Passcode: 422648

Los alumnos deberán asistir a todas clases y ayudantías, siempre con sus cámaras encendidas.

Contenidos:

Clase 1: (3 horas, capítulos 2 y 3)

- Regresión como esperanza condicional.
- Estimación del modelo de regresión lineal.
- Propiedades algebraicas del estimador de MCO.

Clase 2: (3 horas, capítulos 3 y 4)

- Propiedades estadísticas del estimador de MCO.
- Inferencia sobre un parámetro.
- Inferencia sobre un conjunto de parámetros.

Clase 3: (1 hora, capítulo 6)

- Forma funcional y especificación: logaritmos, potencias e interacciones.

Clase 4: (1 hora, capítulo 7)

- Variables binarias independientes.

Clase 5: (2 horas, capítulos 8 y 12)

- Heterocedasticidad.
- Correlación serial o autocorrelación.

Clase 6: (2 horas, capítulos 3 y 9)

- Omisión de variables relevantes e inclusión de variables irrelevantes.
- Errores de medición.

Exigencias:

1. Tareas (24%): después de cada ayudantía, se asignará un ejercicio como tarea que los alumnos deberán resolver a mano, escanear y enviar por correo al ayudante del curso a más tardar el domingo 19 a las 11pm (hora de Honduras). Estas tareas podrán resolverse individualmente o en grupos de hasta 3 alumnos. Cada grupo deberá entregar una única versión de la tarea correspondiente con el nombre de todos los integrantes.
2. Pruebas cortas (21%): el curso contempla una serie de 3 pruebas cortas, individuales, que los alumnos deberán resolver en el horario de clase o ayudantía. Estas pruebas serán de opciones múltiples y tendrán una duración máxima de 10 minutos.

3. Examen (55%): la semana posterior a la finalización de clases se realizará el examen final. La fecha propuesta es el lunes 20 de junio, en horario a coordinar con el Banco Central de Honduras.

Cronograma:

Fecha	8am	9am	10am
Sábado 11	Clase	Clase	Clase
Lunes 13	Clase	Clase	Clase
Martes 14	Clase	Ayudantía	Ayudantía
Miércoles 15	Clase	Ayudantía	Ayudantía
Jueves 16	Clase	Clase	Ayudantía
Viernes 17	Clase	Clase	Ayudantía