

Econometría II (20846)

Majid Al-Sadoon

30 de septiembre de 2012

Objetivos

Esta asignatura introduce herramientas y metodologías avanzadas que nos permiten emprender la inferencia causal y la predicción en el contexto de series de datos tanto transversales como temporales. Se tratarán:

1. La estimación cuando se infringe el supuesto de media condicional cero (variables instrumentales).
2. Análisis e interpretación de datos recogidos en los experimentos y cuasi experimentos.
3. Análisis de las variables dependientes binarias (mínimos cuadrados y máxima probabilidad).
4. Creación de modelos y predicción de los datos macroeconómicos y financieros.
5. Estimación de los efectos causales a través del tiempo.
6. Otros temas como la cointegración y agrupamiento de la volatilidad.

El objetivo general es que el estudiante aprenda teoría y metodología nueva para ayudarlo a realizar un examen crítico de los datos económicos.

Requisitos

La asignatura Econometría II tiene los siguientes requisitos:

1. Conocimientos básicos de los conceptos de la inferencia estadística, la prueba de hipótesis e intervalos constructores de confianza.
2. Conocimiento de la metodología de estimación por MCO, la obtención e interpretación de los estimadores, pruebas de hipótesis, las causas y consecuencias de los problemas de validez interna y externa de los modelos.
3. Conocimientos básicos de la utilización de software econométrico como STATA.
4. Conocimiento de los conceptos básicos de la microeconomía y la macroeconomía que permiten a los estudiantes diseñar e interpretar los resultados de los estudios empíricos mediante las técnicas econométricas estudiadas.

Organización

La docencia consiste en 20 clases de teoría y 6 seminarios de hora y media cada uno. Las clases de teoría desarrollarán los conceptos y metodologías de la asignatura. Los seminarios cubrirán soluciones a los problemas de los diferentes trabajos y cualquier otro material no cubierto en las clases teóricas. Los trabajos para realizar en casa también pueden abarcar la parte no cubierta en las clases.

Se anima a los estudiantes a trabajar en grupos de 3 o 4 componentes, con el fin de practicar el trabajo en equipo y compartir diferentes formas de abordar los problemas. Los miembros de cada grupo deben pertenecer al mismo grupo de seminario. Cada grupo presenta un único conjunto de soluciones para cada conjunto de problemas. Cada miembro de un grupo recibirá la nota correspondiente a las soluciones presentadas (es decir, la misma calificación). Es muy aconsejable participar y hacer preguntas en clases y seminarios.

Evaluación

Para aprobar el curso, se debe obtener al menos 50 puntos sobre 100, de acuerdo con la siguiente distribución:

Deberes: 15 puntos

Asistencia a seminarios: 15 puntos

Examen parcial: 30 puntos

Examen final: 40 puntos

Los deberes se tienen que entregar como máximo a las 12.00 h (mediodía) en las fechas indicadas en el plan de la asignatura. No se aceptará ningún trabajo más tarde de esa hora. Se pasará lista al inicio de cada seminario. Cualquier estudiante que llegue después de haber pasado lista será considerado ausente. El examen parcial está programado para el lunes 05/11/2012 y cubrirá todo el material que se haya impartido hasta ese momento. El examen final cubrirá todos los temas de la asignatura, pero la atención se centrará principalmente en el material impartido después del examen parcial. El examen de recuperación de febrero comporta el 100% de la nota y cubre todos los temas de esta asignatura.

Libro

La asignatura sigue muy de cerca *Introducción a la econometría* (tercera edición), de Stock y Watson. Este libro es útil no sólo como un libro de texto, sino también como una referencia. Las copias del libro de texto están disponibles en la biblioteca de la Universidad. Es responsabilidad del estudiante asegurarse tener acceso a una copia durante el trimestre.

Programación de la asignatura

Fecha Tema y Capítulos

01.10 Repaso (2, 9).

10.02 Repaso (2, 9).

No hay seminarios.

08/10 Instrumento de regresión variable (12).

09/10 Instrumento de regresión variable (12).

No hay seminarios.

15/10 Instrumento de regresión variable (12).

16/10 Los experimentos y cuasi experimentos (13).

17/10 Tarea # 1 entrega.

22/10 Los experimentos y cuasi experimentos (13).

23/10 Los experimentos y cuasi experimentos (13).

24/10 Tarea # 2 entrega.

29/10 Datos binarios (11).

28/10 Datos binarios (11).

No hay seminarios.

05/11 Examen parcial (11/05/2012).

11.6 Series de tiempo (14).

07/11 Tarea # 3 entrega.

12/11 Series de tiempo (14).

13/11 Series de tiempo (14).

14/11 Tarea # 4 entrega.

19/11 Efectos dinámica causal (15).

20/11 Efectos dinámica causal (15).

21/11 Tarea # 5 entrega.

26/11 Efectos dinámica causal (15).

27/11 Temas adicionales en series de tiempo (16).

28/11 Tarea # 6 entrega.

12.3 Los temas adicionales en series de tiempo (16).

12.4 Los temas adicionales en series de tiempo (16).

No hay seminarios.