

PROGRAMA DE ASIGNATURA
Prosecución de estudios en Economía
Segundo semestre de 2016



Asignatura	ECONOMETRÍA II	
Carrera	Ingeniería Comercial	
Código	351477	
Créditos	7 SCT	Tbjo. Directo: 6 hrs. pedag. – Tbjo. Autónomo: 4 hrs. cronolog.
Nivel	6º semestre	
Requisitos	Econometría I	
Categoría	Obligatorio	
Área de conocimiento OCDE	Ciencias Sociales	
Profesor	Damian Clarke	
Correo electrónico	damian.clarke@usach.cl	
Horario	L7-L8-S1. Salas 733, 790	
Ayudante	Benjamín Matta, benjamin.matta@usach.cl	
Atención Alumno/as	Lunes desde 17:00 a 19:00, oficina 205 En caso de no poder concurrir a la hora de atención de alumno/as, agendar una reunión por correo electrónico.	
Sitio web	https://sites.google.com/site/damianclarke/econometria-ii	
Descripción	<p>Contribución al Perfil de Egreso</p> <p>Este curso es la segunda asignatura de Econometría del Grado en Economía. Antes de esta asignatura los estudiantes cursan dos asignaturas de Estadística y la asignatura de Econometría I que cubren técnicas de inferencia estadística y el modelo de regresión lineal. El curso de Econometría II continúa el estudio del modelo de regresión presentado en Econometría I, examinando su aplicación en situaciones más generales. Los nuevos conocimientos adquiridos permitirán al/la alumno/a a realizar trabajos empíricos de investigación cuando se dispone de datos de series temporales o datos longitudinales, y estimar y entender una clase más general de modelos económicos. Además, se examina cómo llevar a cabo la estimación e inferencia cuando no se cumplen los supuestos clásicos del modelo lineal.</p> <p>El análisis teórico se complementa con ejemplos aplicados extraídos de trabajos empíricos, y problemas prácticos donde se analizan datos económicos del mundo real, utilizando un paquete estadístico.</p> <p>Esta asignatura tiene su continuación en los cursos electivos de Microeconometría y Series del Tiempo.</p> <p>Resultado de aprendizaje general</p> <p>Al finalizar el curso, lo/as alumno/as deberán ser capaces de:</p> <ul style="list-style-type: none"> – Entender las técnicas econométricas intermedias para el análisis de datos. – Formular relaciones entre variables económicas, cuantificarlas y entender los resultados obtenidos, en situaciones en las que no se cumplen las hipótesis básicas. – A partir de un modelo econométrico evaluar las diferentes respuestas de una variable económica ante cambios de otra u otras variables. – Saber interpretar correctamente los resultados obtenidos al estimar un modelo en el que no se cumplen las hipótesis básicas. 	
	Resultados de aprendizaje específicos	Unidades temáticas

	Estimar e interpretar correctamente los resultados obtenidos por modelos no lineales.	I Modelos no lineales.
	Entender las técnicas econométricas intermedias para el análisis de datos de series temporales.	II Análisis de regresión lineal con datos de series temporales.
	Entender las técnicas econométricas intermedias para el análisis de datos longitudinales.	III Análisis de regresión lineal con datos longitudinales.
	Utilizar el software Stata para estimar modelos con datos económicos (de individuos, hogares, empresas o países) y realizar hipótesis sobre los mismos.	IV Sesiones de laboratorio en Stata
<p>Metodologías de enseñanza y de aprendizaje</p> <p>La asignatura se desarrolla en combinación de clases dictadas por el profesor, ayudantías y sesiones de laboratorio. Estas actividades se complementan con las hojas de ejercicios que se asignan durante el semestre y el material bibliográfico de referencia.</p> <p>En las clases de teoría se discuten los diversos aspectos teóricos y prácticos y se formalizan los principales conceptos del curso. Se presentan las derivaciones formales y las aplicaciones para resolver los problemas específicos o contextualizados en ejemplos empíricos concretos.</p> <p>Las ayudantías están centradas en la resolución de los problemas, análisis de casos prácticos de estudios académicos, y constituyen una herramienta fundamental para la preparación de las evaluaciones del curso.</p> <p>Uno de los objetivos importantes del curso consiste en lograr que el alumno tenga capacidad de aplicar los modelos econométricos mediante el uso de un paquete estadístico. El software Stata es la herramienta utilizada en este caso. Los diferentes conceptos se discuten en el contexto de casos de estudio en Ciencias Sociales utilizando datos reales.</p> <p>Para el trabajo autónomo se recomienda la lectura de textos, desarrollo de hojas de ejercicios que se asignarán durante el semestre, y revisión de contenidos vistos en cátedra. El objetivo es facilitar el proceso continuo de asimilación de los conceptos a lo largo del semestre. La solución de las hojas de ejercicios se discute durante las ayudantías.</p> <p>Para aclarar dificultades con la materia del curso, se realizan consultas en horario de atención de la/os alumna/os, a través de Intranet, por email, o solicitando una cita con el profesor.</p>		
<p>Procedimientos de evaluación</p> <p>La evaluación de la/el alumna/o se realizará a partir de la consideración de los siguientes aspectos:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Examen final escrito que constará de preguntas teóricas y prácticas. - Examen parcial escrito que constará de preguntas teóricas y prácticas. - Evaluación de las actividades prácticas desarrolladas por el alumno durante el curso, a partir de trabajos elaborados, exposiciones orales, problemas resueltos y/o resultados de los controles. 		

	<p>Bibliografía básica</p> <p>* Wooldridge, Jeffrey M. (2010). <i>Introducción a la Econometría. Un Enfoque Moderno</i>. México, DF: Cengage Learning. Cuarta Edición en Español.</p> <p>Stock, James H, Watson, Mark M. (2012). <i>Introducción a la Econometría</i>. Pearson Educación S.A. Madrid. Tercera Edición en Español.</p> <p>* Lectura obligatoria. Stock y Watson es de lectura optativa, y tiene un tratamiento parecido a la lectura obligatoria (Wooldridge).</p>
--	--

Apéndice

Contenidos Detallados	<p>Tema 1: Elección Binaria</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Introducción. Modelo de probabilidad lineal. 2. Modelos logit y probit para respuestas binarias. 3. Especificación y estimación por máxima verosimilitud de los modelos logit y probit. 4. Interpretación de las estimaciones logit y probit. 5. Contrastes de hipótesis. <p>Tema 2: Selección</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Solución de esquina y el modelo Tobit. 2. Modelos de datos censurados y modelos de regresión truncada. 3. El modelo de regresión de Poisson 4. Correcciones en la selección muestral <p>Tema 3. Tiempo I – Series de Tiempo</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. La naturaleza de los datos de series temporales. Ejemplos de procesos estocásticos. 2. Estimación de MCO. 3. Propiedades en muestras finitas del estimador MCO bajo los supuestos clásicos. 4. Modelos estáticos y de rezagos distribuidos finitos. 5. Formas funcionales. Variables ficticias. Tendencia y estacionalidad. 6. Series temporales estacionarias y débilmente dependientes. <p>Tema 4. Tiempo II – Autocorrelación en Series de Tiempo</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Propiedades del estimador MCO con errores autocorrelacionados. 2. Contrastes de autocorrelación. 3. Solución a la autocorrelación con regresores estrictamente exógenos: MCG y MCGF. 4. MCO con inferencia robusta. Comparación MCO y MCGF. 5. Problemas de endogeneidad por variable dependiente rezagada: estimación VI <p>Tema 5. Análisis de Política Económica</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Datos de secciones cruzadas independientes repetidas a lo largo del tiempo. 2. Análisis de política económica con datos combinados de secciones cruzadas repetidas. 3. Introducción a los datos de panel: panel de dos periodos. 4. Análisis de política económica con datos de panel de dos periodos. 5. Datos de panel con más de dos periodos: modelos de efectos fijos 6. Datos de panel con más de dos periodos: modelos de efectos aleatorios
Bibliografía detallada	<p>Tema I. Elección Binaria</p> <p>* Wooldridge: capítulo 7, sección 7.5; capítulo 17, sección 17.1</p> <p>Stock y Watson: capítulo 11.</p> <p>Tema 2: Selección</p>

	<p>* Wooldridge: capítulo 17, secciones 17.2-17.5.</p> <p>Tema 3. Tiempo I – Series de Tiempo</p> <p>* Wooldridge: capítulo 10, secciones 10.1-10.5.; capítulo 11, sección 11.1, Stock y Watson: capítulos 14 y 15, secciones 14.1-14.3, 14.5, 15.1-15.3</p> <p>Tema 4. Tiempo II – Autocorrelación en Series de Tiempo</p> <p>* Wooldridge: capítulo 12, secciones 12.1-12.3 y 12.5 Stock y Watson: capítulo 15, secciones 15.4, 15.5.</p> <p>Tema 5. Análisis de Política Económica</p> <p>* Wooldridge: capítulo 13, secciones 13.1-13.5; capítulo 14, secciones 14.1-14.2 Stock y Watson: capítulo 10.</p>		
Evaluaciones	EVALUACIÓN	POND.	FECHA
	Primera Prueba Parcial (Calendarizada como "1ª PEP"). Materia: (confirmar contenidos exactos)	35%	17/10/2015
	Controles	15%	Fechas a fijar por el profesor
	Revisión del artículo	10%	Fechas a fijar por el profesor
	Examen (Calendarizado como "2ª PEP"). Toda la materia del semestre.	40%	12/12/2015
	EN CASO DE INASISTENCIA A ALGUNA PRUEBA, DEBIDAMENTE JUSTIFICADA POR EL CONDUCTO REGULAR, LA PONDERACIÓN DE LA PRUEBA NO RENDIDA PASARÁ AL EXAMEN.		