



Nombre de la Asignatura: *Econometría 2*

a) Generalidades

Número de Orden:	30	Código:	ECO 2	Duración del Ciclo en Semanas:	16
Pre-Requisito (s):	ECO 1	Ciclo Académico:	6	Duración /Hora Clase:	50
		Área:	Profesional	Número /Hora Clase por Ciclo:	80
		U.V.:	4	Horas Teóricas/ Semanales:	2
				Horas Prácticas/ Semanales:	3

b) Descripción de la Asignatura:

La asignatura es de naturaleza práctica, orientada a introducir la teoría y práctica del análisis de series de tiempo, así como a la comprensión y manejo del análisis de variables categóricas.

c) Objetivo General de la Asignatura:

Objetivos Cognitivos:

Identificar herramientas metodológicas adicionales que permitan extender el alcance de la capacidad de investigación económica del estudiante.

Objetivos Procedimentales:

Manipular una serie de técnicas estadísticas comúnmente utilizadas en el análisis económico, con énfasis en su aplicación real.

Construir la capacidad de modelar y pronosticar series temporales, leer papers y comenzar a realizar investigación propia sobre el análisis de series temporales.

Objetivos Actitudinales:

Apreciar la importancia de la modelación estadística en el desarrollo de diagnósticos y propuestas económicas.

d) Contenidos:



UNIDAD I: ANÁLISIS DE REGRESIÓN CON SERIES TEMPORALES

Contenido:

- 1.1 Propiedades de estimadores de MCO bajo los supuestos clásicos
- 1.2 Errores con estructura de media móvil de primer orden
- 1.3 Tendencia y estacionalidad
- 1.4 Estacionariedad: Concepto, pruebas Dickey-Fuller
 - 1.4.1 Modelos para procesos estacionarios
 - 1.4.2 Modelos para procesos no estacionarios
- 1.5 Modelos para procesos estacionales

UNIDAD II: AUTOCORRELACIÓN

Contenido:

- 2.1 Naturaleza del problema
- 2.2 Propiedades de estimadores de MCO bajo autocorrelación
- 2.3 Errores autoregresivos de primer orden
- 2.4 Modelos ARIMA
- 2.5 Enfoque Box – Jenkins

UNIDAD III: MODELOS DE ELECCIÓN BINARIA Y MULTINOMIAL

Contenido:

- 3.1 Modelos Logit
 - 3.1.1 Estimación e inferencia
 - 3.1.2 Logit multinomial
 - 3.1.3 Logit condicional
- 3.2 Modelos Probit
 - 3.2.1 Probit bivariado

UNIDAD IV: PRUEBAS DE ESPECIFICACIÓN

Contenido:

- 4.1 Significancia individual
- 4.2 Significancia de grupos de coeficientes

UNIDAD V: APLICACIONES



e) Estrategia Metodológica:

El curso se desarrollará con base en la exposición magistral en un 40%, en la cual el profesor realiza un análisis teórico algebraico, o estadístico sobre todos los temas del curso. Necesariamente la materia requiere prelectura de los contenidos por parte del alumno, y, de ese modo, su participación activa en la clase. De igual forma se analizan problemas tanto teóricos como prácticos, requiriéndose del alumno la aplicación de los contenidos econométricos adquiridos en trabajos exaula continuos, así como en un trabajo de investigación. Para los problemas de tipo práctico, en los cuales se manejan datos reales y simulados, se empleará software econométrico, hoja electrónica y procesador de texto y se le asignará el 60% del tiempo.

f) Bibliografía:

Nombre de la Obra	Autor	Casa editora	País	Año de edición	No. de ejemplares en biblioteca
Análisis de series temporales	Daniel Peña	Alianza Editorial	España	2005	*
Métodos cuantitativos para el análisis de la coyuntura económica	Espasa, A., y Cancelo, J.R.	Alianza Editorial	España	1993	*
Estadística y econometría	Novales, A.	McGraw Hill	España	1997	*

*En proceso de compra