

ECONOMETRÍA II

CLAVE:		SECTOR:	OPTATIVO
SEMESTRE:	6 - 8	ÁREA:	CIENCIAS SOCIALES
CRÉDITOS:	10	SERIACIÓN:	
		ASIGNATURA PRECEDENTE INDICATIVA: Materias del sector básico del Área de Ciencias Sociales y Econometría I	
		ASIGNATURA SUBSECUENTE INDICATIVA: Ninguna	
HORAS POR CLASE		TEÓRICA:	1
CLASES POR SEMANA		TEÓRICA:	5
HORAS POR SEMESTRE		TEÓRICA:	80
		PRÁCTICAS:	0
		PRÁCTICAS:	0
		PRÁCTICAS:	0

Objetivo General: Al final del curso el alumno:

- Comprenderá y será capaz de aplicar las técnicas avanzadas de econometría en la modelación de fenómenos económicos diversos.

Tema 1. Series de tiempo

40 horas

El alumno será capaz de aplicar las herramientas necesarias para llevar a cabo un análisis estadístico de la información disponible en forma de series de tiempo.

- 1.1 Elementos de procesos estocásticos
- 1.2 Introducción a las series de tiempo
- 1.3 Series de tiempo vistas como procesos estocásticos
- 1.4 Procesos divergentes
- 1.5 Modelos autorregresivos
- 1.6 Modelos de promedios móviles
- 1.7 Modelos mixtos
- 1.8 Modelo ARIMA
- 1.9 Contrucción de modelos para series univariadas
- 1.10 Análisis de series de tiempo estacionales
- 1.11 Modelos de análisis de series influenciadas por intervención.

Tema 2. Economía dinámica

40 horas

El alumno aplicará las técnicas para llevar a cabo un análisis econométrico de la información disponible cuando la variable dependiente es cualitativa.

- 2.1 Introducción
- 2.2 Modelos de regresión discreta con variables binarias
- 2.3 Modelos probit y logit
- 2.4 Modelos de regresión discreta cuando la variable toma más de dos valores
- 2.5 Modelos de elección probabilística
- 2.6 Variable dependiente continua pero limitada
- 2.7 Ecuaciones simultáneas con variable dependiente limitada o discreta

Bibliografía básica:

- Amemiya, T. *Advanced Econometrics*. USA. Harvard University Press. 1985.
- Box, G. et. al. *Time Series Analysis: Forecasting and Control*. 1994.
- Chatfield, C. *The Analysis of Time Series. An Introduction*. USA. Chapman & Hall. 1989.
- Green, W. *Econometric Analysis*. USA. Macmillan. 1991.
- Guerrero, V. *Análisis estocástico de series de tiempo económicas*. 1990.

- Hamilton, J. *Time Series Analysis*. USA. Princeton University Press. 1994.
- Johnston, J. *Econometric Methods* USA. McGraw Hill. 1985.
- Judge, G., et. al. *Introduction to the theory and practice of econometrics*. USA Wiley. 1980.

Bibliografía complementaria:

- Hleinbaum, D., et. al. *Applied regression analysis and other multivariate methods*. USA. Duxburg Press and Education. 1988.
- Maddala, G. *Limited-Dependent and Qualitative Variables in Econometrics*. USA. Cambridge University Press. 1983.

Sugerencias didácticas:

Se recomienda el uso de paquetes estadísticos como el SPSS, Statistica o SPlus para el análisis y modelación de los datos.

Es recomendable que se impartan clases en el laboratorio de cómputo para que el alumno aprenda a usar al menos uno de estos paquetes.

Asimismo se sugiere que, al final del curso, el alumno haga un análisis completo de un conjunto de datos y presente los resultados de manera oral y escrita.

Forma de evaluación:

Se recomiendan de 3 a 4 exámenes parciales y un examen final, así como la realización de tareas sobre los temas vistos en clase para reforzar los conocimientos teóricos adquiridos.

Perfil profesiográfico:

El profesor que imparta el curso deberá ser egresado de las carreras de Matemáticas, Actuaría o alguna afin, y deberá tener experiencia docente y práctica en el área econométrica.