

UNIVERSIDAD NACIONAL AUTÓNOMA DE MÉXICO
FACULTAD DE CIENCIAS
CARRERA DE MATEMÁTICO

ECONOMETRÍA II

SEMESTRE: **Séptimo u octavo**
CLAVE: **1063**

HORAS A LA SEMANA/SEMESTRE		
TEÓRICAS	PRÁCTICAS	CRÉDITOS
5/80	0	10

CARÁCTER: **OPTATIVO.**

MODALIDAD: **CURSO.**

SERIACIÓN INDICATIVA ANTECEDENTE: **Econometría I.**

SERIACIÓN INDICATIVA SUBSECUENTE: **Ninguna.**

OBJETIVO(S): Al finalizar el curso el alumno comprenderá y será capaz de aplicar las técnicas avanzadas de econometría en la modelación de fenómenos económicos diversos.

NUM. HORAS	UNIDADES TEMÁTICAS
40	1. 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 Construcción de modelos para series univariadas.
	1.10 Análisis de series de tiempo estacionales.
	1.11 Modelos de análisis de series influenciadas por intervención.
40	2. Economía dinámica
	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:

1. Amemiya, T., *Advanced Econometrics*, Harvard: Harvard University Press, 1985.
2. Box, G., et. al. *Time Series Analysis: Forecasting and Control*, New Jersey: Prentice Hall, 1994.
3. Chatfield, C., *The Analysis of Time Series. An Introduction*, Boca Raton, Florida: Chapman and Hall/CRC, 2004.
4. Greene, W., *Econometric Analysis*, New Jersey: Prentice Hall, 2000.
5. Guerrero, V., *Análisis Estadístico de Series de Tiempo Económicas*, México: International Thomson, 2003.
6. Hamilton, J., *Time Series Analysis*, Princeton: Princeton University Press, 1994.
7. Johnston, J., *Econometric Methods*, New York: McGraw-Hill, 1997.
8. Judge, G., et. al., *Introduction to the Theory and Practice of Econometrics*, New York: J. Wiley, 1980.

BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA:

1. Kleinbaum, D., et. al., *Applied Regression Analysis and other Multivariate Methods*, Pacific Grove, California ; México: Duxbury, 1998.
2. Maddala, G., *Limited-Dependent and Qualitative Variables in Econometrics*, Cambridge: Cambridge University Press. 1983.

SUGERENCIAS DIDÁCTICAS: Lograr la participación activa de los alumnos mediante exposiciones.

SUGERENCIA PARA LA EVALUACIÓN DE LA ASIGNATURA: Además de las calificaciones en exámenes y tareas se tomará en cuenta la participación del alumno.

PERFIL PROFESIOGRÁFICO: Matemático, físico, actuariario o licenciado en ciencias de la computación, especialista en el área de la asignatura a juicio del comité de asignación de cursos.