

ESCUELA POLITÉCNICA NACIONAL

PROGRAMA DE ESTUDIOS DE ECONOMETRÍA II

UNIDAD ACADÉMICA:	Facultad de Ciencias		
CARRERA:	Ingeniería en Ciencias Económicas y Financieras		
EJE DE FORMACIÓN:	Formación Profesional		
ASIGNATURA:	Econometría II		
CÓDIGO:	CEF626	PENSUM:	2010
SEMESTRE REFERENCIAL:	6	NRO. CRÉDITOS:	6
TIPO:	Obligatoria: <input checked="" type="checkbox"/>	Optativa: <input type="checkbox"/>	
HORAS SEMANALES:	Teóricas: 4	Prácticas de Laboratorio/Ejercicios:	2
TOTAL DE HORAS:	Teóricas: 56	Prácticas de Laboratorio /Ejercicios: Actividades de Evaluación:	32 8

ASIGNATURAS REQUISITOS:

Econometría I (CEF546)

OBJETIVOS DEL CURSO:

Objetivos de Conocimientos

- Adquirir los conceptos, criterios y técnicas para la realización de modelización de series temporales
- Conocer los diferentes modelos de series temporales.

Objetivos de Destrezas

- Aplicar los modelos de series temporales para explicar los problemas reales de la economía.
- Reconocer los principales problemas que presentan los modelos de series temporales y solucionarlos.
- Ajustar modelos de series temporales aplicados a la economía.
- Interpretar y analizar los resultados obtenidos.

Objetivos de Valores y Actitudes

- Actuar con responsabilidad personal, con posturas íntegras de lealtad y honorabilidad, tomando en cuenta que el manejo de datos y la formulación de modelos lleva implícito dichas características.
- Reforzar y ampliar fuera del aula los conocimientos adquiridos en relación a la econometría.

CONTENIDOS:

Capítulo 1: **Modelos de series temporales**

- 1,1 Primeras Definiciones
- 1,2 Modelos autorregresivos y de medias móviles. Modelos ARMA
- 1,3 Variables no estacionarias. Estacionariedad e invertibilidad. Modelos ARIMA
- 1,4 Estacionalidad. Modelos SARIMA
- 1,5 Predicción con modelos SARIMA
- 1,6 Estimación de modelos SARIMA. Diagnóstico del modelo
- 1,7 Modelos de función de transferencia. Algunos ejemplos

Capítulo 2: **Regresión con variables no estacionarias**

- 2,1 Introducción
- 2,2 Contrastes de raíz unitaria de Dickey y Fuller
- 2,3 Contrastación en modelos autorregresivos de orden superior
- 2,4 Contrastación en modelos con estructura MA
- 2,5 Contraste de k raíces unitarias
- 2,6 Integración y estacionalidad
- 2,7 Estacionalidad y cointegración
- 2,8 Aplicaciones del concepto de cointegración
- 2,9 Vectores autorregresivos

Capítulo 3: **Variables dependientes cualitativas y limitadas**

- 3,1 Modelos de elección discreta
- 3,2 Variables dependientes limitadas

Capítulo 4: **Proyecto práctico**

PRÁCTICAS DE LABORATORIOS/EJERCICIOS:

Tópico 1:	Modelos autorregresivos y de medias móviles. Modelos ARMA
Tópico 2:	Predicción con modelos SARIMA
Tópico 3:	Estacionalidad y cointegración
Tópico 4:	Modelos de elección discreta

BIBLIOGRAFÍA BÁSICA:

1	GUJARATI DAMODAR, " Econometría ", McGRAW-HILL- Interamericana de España, S.A.U. quinta edición, 914 páginas, 2010.
2	NOVALES ALFONSO " Econometría ", segunda edición, Madrid-España, McGraw — Hill, 676 págs. 1993.

BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA:

1	EZEQUIEL URIEL, " Análisis de Series Temporales modelos ARIMA ", Paraninfo, tercera edición, 270 págs. 1995.
---	---

SUGERENCIAS DIDÁCTICAS:

Exposición oral (clase magistral)	<input checked="" type="checkbox"/>	Exposición audiovisual	<input checked="" type="checkbox"/>
Ejercicios dentro de clase	<input checked="" type="checkbox"/>	Ejercicios fuera del aula	<input checked="" type="checkbox"/>
Conferencias (profesores invitados)	<input type="checkbox"/>	Lecturas obligatorias	<input type="checkbox"/>
Prácticas de laboratorio	<input checked="" type="checkbox"/>	Prácticas de campo	<input type="checkbox"/>
Trabajos de investigación	<input checked="" type="checkbox"/>	Desarrollo de un proyecto	<input checked="" type="checkbox"/>
Otras	<input type="checkbox"/>		<input type="checkbox"/>

FORMAS DE EVALUAR:

Pruebas parciales	<input checked="" type="checkbox"/>	Examen final	<input checked="" type="checkbox"/>
Trabajos y tareas fuera del aula	<input checked="" type="checkbox"/>	Asistencia a prácticas	<input type="checkbox"/>
Participación en clase	<input checked="" type="checkbox"/>	Otras	<input checked="" type="checkbox"/>

REQUISITOS DE EXPERIENCIA Y CONOCIMIENTOS DEL PROFESOR:

Profesional de cuarto nivel con experiencia laboral, docente o de investigación en la rama. Matemático o

REQUERIMIENTOS DE INFRAESTRUCTURA:

Equipamiento básico de aulas, material de papelería (marcadores y borrador de pizarrón), equipo de Laboratorio equipado con paquetes estadísticos: SPSS, NCSS, Gretel, E-views, Statgraphics, Stata.