|  |
| --- |
| **Datos de identificación** |
| **Programa** | **MAESTRÍA EN ECONOMÍA APLICADA** |
| **Nombre de la asignatura** | **Econometría II** | **Ciclo** | **Segundo semestre** |
| **Tipo de Asignatura** |     |    |
| **Modalidad** |    | **Instalaciones** |    Otro:  |
| **Clave** | **14MEA0210** | **Seriación** | Econometría I | **Clave seriación** | 14MEA0104 |
| **Horas** **teóricas** | **23** | **Horas** **laboratorio**  | **22** | **Horas prácticas de campo** |  | **Total** **de horas** | **45** | **Total** **de créditos** | **6** |
| **Definiciones generales de la asignatura** |
| **Aportación de esta materia al perfil de egreso de la/el estudiante** | Aporta al desarrollo de habilidades para utilizar, en forma rigurosa, herramientas avanzadas de investigación de corte cuantitativo. |
| **Descripción de la orientación de la asignatura en coherencia con el perfil de egreso** | El objetivo del curso se centra en la estimación de las relaciones cuantitativas de los más importantes trabajos econométricos, al igual que la implementación empírica de la economía. El estudiante conocerá y aplicará los conceptos y técnicas fundamentales de las series de tiempo univariadas y multivariadas para fines de pronóstico, análisis, e investigación empírica. |
| **Cobertura de la asignatura** | Durante el curso, el estudiante aprenderá las principales técnicas econométricas y a utilizar los paquetes estadísticos de estimación. Estos dos elementos son necesarios para la comprensión de los conceptos teóricos al igual que empíricos de la econometría. |
| **Profundidad de la asignatura** | El curso enfatiza tanto la teoría como la praxis en la estimación de diferentes tipos de modelos: ARIMA, VAR, VEC y SVAR. |
| **Temario** |
| **Unidad** | **Objetivo** | **Tema** | **Producto a evaluar**  |
| 1. Series de tiempo univariadas, primera parte | Comprender las principales técnicas de series de tiempo univariadas. | 1.1. Estacionariedad, raíces unitarias y cointegración1.2. Proceso estocástico estacionario1.3. Prueba de estacionariedad basada en el correlograma1.4. Prueba de raíz unitaria sobre estacionariedad1.5. Proceso estocástico estacionario alrededor de una tendencia (TS) y estacionario en diferencia (DS)1.6. Regresión espuria1.7. Pruebas de cointegración 1.8. Aplicaciones | * Examen parcial
* Resolución de ejercicios
* Trabajo final
 |
| 2. Series de tiempo univariadas, segunda parte: pronósticos con modelos ARIMA | Fortalecer la comprensión de técnicas de series de tiempo univariadas y la elaboración de pronósticos. | 2.1. Enfoques para la predicción económica 2.2. Elaboración de modelos AR, MA, ARMA y ARIMA2.3. Método Box-Jenkins (BJ)2.4. Identificación2.5. Estimación de modelos ARIMA2.6. Pronóstico2.7. Aspectos adicionales de la metodología BJ2.8. Aplicaciones | * Examen parcial
* Resolución de ejercicios
* Trabajo final
 |
| 3. Modelos de autorregresión vectorial (modelos VAR) | Comprender los modelos autorregresivos tipo VAR. | 3.1. Modelos VAR no estructurales3.2. Estabilidad y estacionariedad en un modelo VAR3.3. Estabilidad y raíces en un modelo univariado3.4. Valores eigen y raíces: el modelo multivariado3.5. ¿Qué hacer en caso de que haya una raíz unitaria? | * Examen parcial
* Resolución de ejercicios
* Trabajo final
 |
| 4. Modelos multivariados (o vectoriales) de corrección de errores (modelos VEC) | Comprender modelos multivariados de corrección de errores. | 4.1. El modelo bivariado4.2. Los valores eigen П y la existencia de vectores de cointegración4.3. Más de un vector de cointegración4.4. Rezagos prolongados4.5. El modelo multivariado: la existencia de una raíz unitaria y el rango reducido de П | * Examen parcial
* Resolución de ejercicios
* Trabajo final
 |
| 5. Pruebas de cointegración multivariadas | Desarrollar habilidades y capacidades para realizar pruebas de cointegración. | 5.1. Bases para la inferencia sobre el rango cointegrador5.2. Estimación de un modelo VAR no restringido (modelo UVAR) 5.3. Pruebas de hipótesis sobre el rango cointegrador5.4. Un método alternativo para seleccionar el rango cointegrador5.5. Interceptos y tendencias en el modelo VAR para las estadísticas de traza y máximo valor eigen5.6. Separando las variables I(1) y las I(0) | * Examen parcial
* Resolución de ejercicios
* Trabajo final
 |
| 6. Identificación  | Desarrollar la capacidad para identificar los modelos de series de tiempo principales. | 6.1. Forma estructural y reducida del modelo de corrección de errores (VEC)6.2. Identificación de los vectores de cointegración6.3. Pruebas para detectar restricciones sobre-identificadoras en los vectores de cointegración6.4. Identificación de la estructura de corto plazo6.5. Conclusiones | * Examen parcial
* Resolución de ejercicios
* Trabajo final
 |
| 7. Modelos estructurales de autorregresión vectorial (modelos SVAR) | Profundizar en la comprensión de modelos estructurales. | 7.1. Método de Amisano y Giannini7.2. Método de Blanchard y Quah7.3. Condiciones de identificación | * Examen parcial
* Resolución de ejercicios
* Trabajo final
 |
| 8. Aplicaciones de la econometría de series de tiempo | Desarrollar aplicaciones asociadas a la investigación de tesis. | 8.1. Bases de datos disponibles y programación8.2. Aplicaciones a escala meso8.3. Aplicaciones a escala macro8.4. Otra aplicaciones | * Examen parcial
* Resolución de ejercicios
* Trabajo final
 |
| 9. Filtros de Kalman | Expresar los sistemas dinámicos en forma de la representación llamada estado-espacio. | 9.1. La representación estado-espacio de los sistemas dinámicos9.2. Derivación de los filtros de Kalman9.3. Pronósticos basados en la representación estado-espacio | * Examen parcial
* Resolución de ejercicios
* Trabajo final
 |
| **Estrategias de aprendizaje utilizadas** |
| El curso se desarrollará mediante los siguientes elementos:* Con el apoyo de la exposición por parte del profesor, los estudiantes resolverán problemas y aplicarán las técnicas aprendidas mediante el uso del paquete econométrico E-views, R, Stata u otros que se requieran. Al final de curso, los estudiantes presentarán un examen, una breve investigación empírica consistente en la formulación y estimación de un modelo (meso o macroeconómico), la realización de las pruebas de hipótesis correspondientes y la interpretación de los resultados obtenidos.
* Es altamente recomendable que los ejercicios empíricos seleccionados estén asociados con la elaboración de la tesis. El profesor, en coordinación con los directores de tesis, recomendará la lectura de artículos básicos donde se apliquen las técnicas econométricas requeridas para abordar problemas de investigación similares a los planteados por los alumnos en sus tesis.
 |
| **Métodos y estrategias de evaluación** |
| La calificación final estará compuesta de la siguiente manera:* Exámenes, 50%
* Elaboración y presentación del trabajo empírico, 30%
* Resolución de ejercicios teórico-prácticos, 20%
 |
| **Bibliografía** |
| **Básica**Hamilton, J.H., 1994, *Time series analysis*, Princeton University Press.Lütkepohl, H., 2007, *New introduction to multiple time series analysis*, Nueva York, Springer.Patterson, K., 2000, *An introduction to applied econometrics: a time series approach*, Londres, MacMillan.Pindyck, R. y D. Rubinfeld, 2001, *Econometría: modelos y pronósticos*, 4ª ed., México, McGraw-Hill.**Complementaria**Bails S.G. y L.C. Peppers, 1993, *Business fluctuations: forecasting techniques and applications*, 2ª ed., Englewood Cliffs, New Jersey, Pretince Hall.Berndt, E.R., 1990, *The practice of econometrics: classic and contemporany*, 3ª ed., Addison-Wesley Publishing Company.Box G. y G. Jenkins, 1976, *Time series analysis: forecasting and control*, Revised Edition, Holden-Day.Capron L.H y B. Williams, 1984, *Appendix: a course of programming in Basic*, 2ª ed., The Benjamin/Cummings Publishing Company Inc.Greene, W.H., 2000, *Econometric analysis*, 4th ed., Macmillan Publishing Company.Gujarati, D., 1995, *Basic Econometrics*, 3rd ed., New York, McGraw-Hill.Intrilligator, M.D., 1978, *Econometrics models, techniques and applications*, New Jersey, Prentice-Hall.Johnston, J. y J. Dinardo, 1999, *Econometrics methods*, 4th ed., New York, McGraw-Hill.Madala, G.S., 1977, *Econometics*, México D.F., McGraw-Hill.Mark, N., 2001, *International macroeconomics and finance: theory and econometric methods*, Massachusetts, Blackwell Publishers.Odum, H.T y E.C. Odum, 2000, *Modeling for all scales: an introduction to system simulation*, Academic Press. |