

 <b>UNIVERSIDAD NACIONAL AUTÓNOMA DE MÉXICO</b> <b>PROGRAMA ÚNICO DE ESPECIALIZACIONES EN ECONOMÍA</b> <b>ESPECIALIZACIÓN EN ECONOMETRÍA APLICADA</b> <b>Programa de actividad académica</b>			
<b>Denominación: Microeconometría</b>			
Clave: 48163	Semestre: 2°	Campo de conocimiento: Econometría Aplicada	No. Créditos: 8
Carácter: Optativa	Horas		Horas al semestre
Tipo: Teórico-Práctica	Teoría:	Práctica:	Horas por semana
	2	2	
Modalidad: Curso/Taller	Duración del curso: Semestral		

Actividad académica con seriación subsecuente: Ninguna
Actividad académica con seriación antecedente: Ninguna
<b>Objetivo general:</b> El alumno conocerá los diferentes modelos microeconómicos y efectuará aplicaciones empíricas al análisis competitivo de la empresa, microdatos derivados de encuestas, modelos financieros, entre otros.
<b>Objetivos específicos:</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Que el alumno formule un modelo microeconómico para la economía mexicana a partir de alguna de las técnicas desarrolladas en clase.</li> <li>• Que al alumno desarrolle alguno de los modelos microeconómicos a través de un software especializado: STATA</li> </ul>
<b>Índice Temático</b>

Unidad	Temas	Horas	
		Teóricas	Prácticas
1.	Análisis de volatilidad	8	8
2.	Métodos no paramétricos	4	4
3.	Modelos con variable dependiente discreta	6	6
4.	Modelos con variable dependiente limitada	10	10
5.	Modelos de duración	4	4
<b>Total de horas:</b>		32	32
<b>Suma total de horas:</b>		64	

<b>Temario</b>	
Unidad	Tema y Subtemas
1.	1. Análisis de volatilidad 1.1. Introducción. 1.2. Modelos ARCH 1.3. Modelos GARCH 1.4. Modelos GARCH-M
2.	2. Métodos no paramétricos

	2.1 Método de estadística multivariada
3.	3. Modelos con variable dependiente discreta 3.1. Bernoulli: modelo lineal de probabilidad, Logit y Probit 3.2. Multinomial 3.3. Estimación
4.	4. Modelos con variable dependiente limitada 4.1. Distribuciones truncadas 4.2. Muestras censuradas (Tobit) 4.3. Modelos con selección de muestras (Heckman)
5.	5. Modelos de duración

**Bibliografía básica:**

- Cameron, A. C., & Trivedi, P. K. (2005). *Microeconometrics: methods and applications*. Cambridge university press. Capítulos. 14, 15, 16, 21, 22, 23.
- Cameron, A. C., & Trivedi, P. K. (2010). *Microeconometrics using stata*. <http://EconPapers.repec.org/RePEc:tsj:spbook:musr> Capítulos. 8, 9, 14, 15, 16 y 18.

**Bibliografía complementaria:**

- Ahn, S.C. y Schmidt, P. (1995). *Efficient Estimation of Models for Dynamic Panel Data*, *Journal of Econometrics*, Vol. 68, pp. 5-27
- Anderson, T. y Hsiao, C. (1982). *Formulation and Estimation of Dynamic Models using Panel Data*, *Journal of Econometrics*, 18, 67-82.
- Anselin, L. (2001). *Spatial Econometrics*, in B. Baltagi (ed.), *A Companion to Theoretical Econometrics*, Blackwell, Oxford.
- Arellano, M. y Bover, O. (1995). *Another Look at the Instrumental Variable Estimation of Error-Components Models*, *Journal of Econometrics*, Vol. 68, pp. 29-51.
- Barro, R. (1991). *Economic Growth in a Cross Section of Countries*, *Quarterly Journal of Economics*, Vol. 106, pp. 407-443.
- Bernard, A. B. y S. N. Durlauf (1995). *Convergence in International Output*, *Journal of Applied Econometrics*, Vol. 10, pp. 97-108
- Binder, M., Hsiao, C. y Pesaran, M. H. (2005). *Estimation and Inference in Short Panel Vector Autoregressions with Unit Roots and Cointegration*, *Econometric Theory*, 21, 795-837
- Brendt R. E. (2000). *The Practice of Econometrics: Classic and Contemporary*. Addison-Wesley.
- Greene, W. H. (1999). *Análisis econométrico*. Ed. Prentice Hall.
- Maddala, G. S. (1971). *The Use of Variance Components Models in Pooling Cross-Section and Time-Series Data*, *Econometrica*, Vol. 39, pp. 341-360

**Sugerencias didácticas:**

- Replicar las estimaciones microeconómicas de un documento publicado.
- Presentaciones en clase.
- Discusión de los aspectos microeconómicos derivados de los modelos.

**Métodos de evaluación:**

- Asistencia puntual.
- Tareas y participación en clase.
- Trabajo final: elaboración de ensayo con aplicación microeconómica.
- Examen.

**Perfil profesional:**

Profesor académico titulado con especialización en microeconomía y con amplia experiencia docente.