



UNIVERSIDAD NACIONAL AUTÓNOMA DE MÉXICO
PROGRAMA ÚNICO DE ESPECIALIZACIONES EN ECONOMÍA
ESPECIALIZACIÓN EN ECONOMETRÍA APLICADA
Programa de actividad académica



Denominación: Metodología de la Investigación y la Modelación Econométrica Aplicada

Clave: 48156	Semestre: 1°	Campo de conocimiento: Econometría Aplicada	No. Créditos: 8
Carácter: Obligatorio	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

Objetivo general

Introducir a los alumnos en la especificación de modelos econométricos modernos, para potenciar los alcances del aprendizaje y de la investigación aplicada.

Con lo anterior el alumno podrá plantear y discernir de manera clara y eficiente los elementos de un problema de investigación, lo que permitirá ordenar sus ideas en un marco para el planteamiento de un protocolo de investigación estándar que a la postre se derive en una hipótesis verificable mediante la modelación econométrica.

Objetivos específicos:

- El alumno usará a la modelación econométrica como un instrumento básico de trabajo y –más aún– amigable, para explicar los hechos económicos y, sobre todo, fundamental para la toma racional y reflexiva de decisiones y también para planear el futuro.
- El alumno realizará propuestas de investigaciones coherentes y ordenadas.
- El alumno podrá construir un proyecto econométrico aplicado, haciendo énfasis en la presentación del reporte o producto final.
- El alumno propondrá hipótesis comprobables de manera cuantitativa.
- El alumno obtendrá las nociones para realizar pronósticos fiables.
- El alumno obtendrá las nociones para realizar evaluación de políticas.
- El alumno obtendrá las nociones para realizar escenarios y análisis de prospectiva.

Índice Temático

Unidad	Temas	Horas	
		Teóricas	Prácticas
1.	La Investigación y la modelación económica	3	3
2.	Los modelos econométricos	3	3
3.	El proyecto econométrico	2	2
4.	En defensa de la macroeconometría estructural	2	2
5.	Hacia una nueva econometría estructural	8	8

6.	Construcción de un modelo estructural de demanda agregada para la economía mexicana, 1970-2003	9	9
7.	Temas Selectos de microeconomía	2	2
8.	Temas Selectos de macroeconomía	3	3
Total de horas:		32	32
Suma total de horas:		64	

Temario	
Unidad	Tema y Subtemas
1	1. La Investigación y la modelación económica 1.1. La ciencia y la economía 1.2. La modelación económica y la cientificidad 1.3. El proceso de modelar 1.3.1. El papel de los supuestos 1.3.2. Manejabilidad de los modelos
2	2. Los modelos econométricos 2.1. Tipos de modelos económicos 2.2. El modelo econométrico y la econometría como instrumentos de análisis
3	3. El proyecto econométrico 3.1. Utilidad 3.2. Elaboración del proyecto 3.3. Diseño del proyecto 3.4. El proceso de investigación 3.5. Presentación del reporte o producto final
4	4. En defensa de la macroeconometría estructural 4.1. El consenso keynesiano 4.2. La crisis del consenso y los cambios estructurales 4.3. La filosofía de los modelos estructurales 4.4. La metodología tradicional básica 4.5. Críticas adicionales
5	5. Hacia una nueva econometría estructural 5.1. Metodologías alternativas 5.2. El equilibrio propuesto por la nueva macroeconometría estructural (nme) 5.3. La metodología del nuevo enfoque econométrico 5.3.1. La <i>exogeneidad</i> : punto neurológico de la econometría Moderna 5.3.2. La cointegración
6	6. Construcción de un modelo estructural de demanda agregada para la economía mexicana, 1970-2003 6.1. Aspectos generales 6.2. Estimación individual de ecuaciones 6.2.1. Generalidades 6.2.2. Formas funcionales a. Lineal b. Funciones logarítmicas 6.2.3. El consumo privado (CE) 6.2.4. La inversión privada (IFP) 6.2.5. Exportaciones totales de mercancías (X)

	6.2.6. Importaciones totales de mercancías (M) 6.2.7. Saldo de cuenta corriente (CC)
7	7. Temas Selectos de microeconomía 7.1 La elección del consumidor 7.2 El problema del productor
8	8. Temas Selectos de macroeconomía 8.1 Modelo Clásico 8.2 Modelo Keynesiano 8.3 Expectativas racionales 8.4 Síntesis Neo Keynesiana

Bibliografía básica:

- Castro, C., Loría, E. y Mendoza, M. A. (1997). *Eudoxio: modelo macroeconómico de la economía mexicana*. UNAM, México. Todo el libro.
- Kennedy, P. E. (2002). Sinning in the basement: What are the rules? The ten commandments of applied econometrics. *Journal of Economic Surveys*, 16(4), 569-589.
- Loría, E. (2007). *Econometría con aplicaciones*. Ed. Pearson, México. Capítulos 1, 2, 3 y 4.
- Peña, D. (2002). *Análisis de datos multivariantes (Vol. 24)*. Madrid: McGraw-Hill.
- Varian, H. R. (1997). How to build an economic model in your spare time. *The American Economist*, 3-10.

Bibliografía complementaria:

- Allais, M. (1978). *Posibilidad y peligros de la utilización del método matemático en economía*, en Dagum (1978).
- Ball, L. (1998). *Policy Rules for Open Economies*, NBER Working Paper Series. Núm. 6760, National Bureau of Economic Research, Cambridge.
- Barbancho, A. (1976). *Fundamentos y posibilidades de la econometría*. Ariel, 4ª. Ed. Barcelona.
- Beltrán del Río, A. et al. (1991). *Macroeconometric Model Building of Latin American Countries, 1965-1985*, en Klein, L., R. Bodkin & K. Marwah L.
- Bernanke, B. y Mishkin, F. (1997). Inflation Targeting: A New Framework for Monetary Policy?, *Journal of Economic Perspectives*. Núm. 2, Vol. 11.
- Blanco, J. (2003). *La UNAM y el Desarrollo Nacional, Economía Informa*. Núm. 321, noviembre. UNAM. México.
- Castro, C., Loría, E. y Mendoza, M. A. (1997). *Eudoxio: modelo macroeconómico de la economía mexicana*. 1ª reimpresión (2000), UNAM, México.
- Malinvaud, E. (2004). *Econometric Methodology at the Cowles Commission: Rise and Maturity*. <<http://cowles.econ.yale.edu/about-cf/50th/malinvaud.htm>>, enero 26, 2004.
- O'Connor J.J., Robertson, E.F. (2003). Mathematics and Statistics, <<http://www-history.mcs.st-andrews.ac.uk/history/Mathematicians/Listing.html>> OIT
- Sánchez-Vargas, A. (2002). *Vector Autoregressions. The Probabilistic Reduction Approach Versus the Traditional Approach*. Mimeo. UNAM

Sugerencias didácticas:

- Discusión grupal de trabajos de econometría aplicada. Reflexión crítica sobre la pertinencia de los modelos y su validez estadística.
- Discusión de las implicaciones para la teoría económica de los resultados aplicados y de inferencias: pronósticos, pruebas de hipótesis, etc.

Métodos de evaluación:

- Asistencia puntual.
- Tareas y participación en clase.
- Trabajo final: proyecto econométrico aplicado a problemas de la economía mexicana.
- Examen.

Perfil profesiográfico:

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