

		UNIVERSIDAD NACIONAL AUTÓNOMA DE MÉXICO PROGRAMA ÚNICO DE ESPECIALIZACIONES EN ECONOMÍA ESPECIALIZACIÓN EN ECONOMETRÍA APLICADA Programa de actividad académica			
Denominación: Econometría Intermedia					
Clave: 48159		Semestre: 1°		Campo de conocimiento: Econometría Aplicada	
No. Créditos: 8					
Carácter: Obligatorio			Horas		Horas por semana
					Horas al semestre
Tipo: Teórico-Práctica			Teoría:	Práctica:	4
			2	2	
Modalidad: Curso/Taller			Duración del curso: Semestral		

Actividad académica con seriación subsecuente: Ninguna			
Actividad académica con seriación antecedente: Ninguna			
Objetivo general:			
<ul style="list-style-type: none"> • Que el alumno describa los conceptos fundamentales del Análisis de Regresión Lineal Clásico Múltiple, así como su implementación práctica a través de paquetería de cómputo especializada. 			
Objetivos específicos:			
<ul style="list-style-type: none"> • Que el alumno identifique cuáles son los usos, alcances y limitaciones del Análisis de Regresión Lineal Múltiple. • Que el alumno sea capaz de evaluar diferentes modelos econométricos a través de estadísticos y pruebas de correcta especificación modernos. • Que el alumno sea capaz de plantear modelos de Regresión Lineal Múltiple para analizar problemas económicos específicos. • Que el alumno maneje el paquete estadístico STATA y sea capaz de escribir rutinas econométricas para el análisis de datos. 			
Índice Temático			
Unidad	Temas	Horas	
		Teóricas	Prácticas
1.	Econometría: definición, uso y alcances	8	8
2.	El Modelo de Regresión Lineal Múltiple	8	8
3.	Propiedades de los estimadores de MCO	8	8
4.	Estadísticos de correcta especificación	8	8
Total de horas:		32	32
Suma total de horas:		64	

Temario	
Unidad	Tema y Subtemas
1.	1. Econometría: definición, uso y alcances 1.1 Tipo de datos econométricos 1.2 Datos de Sección Cruzada 1.3 Datos de Series de Tiempo 1.4 Datos Longitudinales 1.5 Correlación vs. Causalidad
2.	2. El Modelo de Regresión Lineal Múltiple 2.1. El modelo teórico 2.2. El modelo matemático 2.3. El modelo estadístico 2.4 Métodos de estimación 2.5. Mínimos Cuadrados Ordinarios (MCO) 2.6. Máxima Verosimilitud (MV) 2.7. Método Generalizado de Momentos (MGM)
3.	3. Propiedades de los estimadores de MCO 3.1. Propiedades algebraicas 3.2. Propiedades estadísticas 3.3. Bondad de ajuste y análisis de la varianza 3.4. Forma Funcional y Cambio Estructural 3.5. Especificaciones dinámicas
4.	4. Estadísticos de correcta especificación 4.1. Violación de los supuestos estadísticos 4.2. Normalidad 4.3. No Autocorrelación 4.4. No Heteroscedasticidad 4.5. Estabilidad de parámetros 4.6. Criterios para selección de modelos Akaike Y S

Bibliografía básica:

- Dhrymes, P. J., E. P. Howrey, S. H. Hymans, J. Kmenta, E. E. Leamer, R. E. Quandt, J. B. Ramsey, H. T. Shapiro y V. Zarnowitz (1972). "Criteria for Evaluation of Econometric Models", *Annals of Economic and Social Measurement*, 1, 3, 291-324.
- Gilbert, C.L. (1986). "Professor Hendry's Econometric Methodology", *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*, 48, 3, 283-307.
- Granger, C. W. J. y P. Newbold (1974). "Spurious Regressions in Econometrics", *Journal of Econometrics*, 2.
- Greene, W. (2011). *Econometric Analysis*, Pearson, Boston, 7^o edition. Capítulos.1, 2, 3, 4, 6, 8, 9.
- Gujarati, D. (2003). *Basic econometrics*, 4th ed., McGraw Hill, USA.
- Intriligator, M. (1990). *Modelos econométricos, técnicas y aplicaciones*, 1a. ed., FCE, México
- Intriligator, M., R. Bodkin y C. Hsiao (1996). *Econometric models, Techniques and applications*, 2nd ed. Prentice Hall.
- Johnston, J. y D. Di Nardo (1997). *Econometric Methods*, 4th Ed. McGraw-Hill.
- Maddala, G. S. (2001). *Introduction to Econometrics*, 3th ed. Prentice Hall.
- Patterson, K. (2000). *An Introduction to Applied Econometrics. A Time Series Approach*, GB.
- Peña, J., J. Estavillo, M. E. Galindo, M. J. Leceta y M. Zamora. (1999). *Cien ejercicios de Econometría*, Ediciones Pirámide, España.

<ul style="list-style-type: none"> • Phillips, P. C. B. (1988). "Reflections on Econometric Methodology", <i>Economic Record</i>, 64, 187, 34. • Phillips, P. C. B. (1996). "Econometric Model Determination", <i>Econometrica</i>, 64, 4, 763-812. • Pindyck, R. S. y D. Rubinfeld (1998). <i>Econometric Models and Economic Forecasts</i>. 4th, McGraw Hill, Singapore. • Pulido, A. y J. Pérez-García(2001). <i>Modelos Económicos</i>, Ediciones Pirámide, España. • Spanos, A. (1989). "On Rereading Haavelmo: A Retrospective View of Econometric Modeling", <i>Econometric Theory</i>, 5, 3, 405-429. • Wooldridge, J. (2006). <i>Introductory Econometrics</i>, South Western, Michigan. Capítulos 1, 2, 3, 4, 5, 6, 8 y 9. 	
<p>Bibliografía complementaria:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Berkovitz, J. (1995). "What Econometrics Cannot Teach Quantum Mechanics", <i>Studies in History and Philosophy of Science, Part B</i> 26 (2):16. • Booth, D. (1991). "The Axiomatic Method in Economics and Econometrics", <i>Journal of Symbolic Logic</i>, 56 (3):1102-1103. • Cassoni, A. (1991). <i>Pruebas de diagnóstico en el modelo econométrico</i>, Documentos de Trabajo, CIDE, México. • Chao, H. (2005). "A Misconception of the Semantic Conception of Econometrics?" <i>Journal of Economic Methodology</i>, 12 (1):125-135. • Davidson, J. E. H. y D. F. Hendry (1981). "Interpreting Econometric Evidence: The Behaviour of Consumers' Expenditure in the UK", <i>European Economic Review</i>, 16, 1, 177-192. • Galindo, L. M. (1997). <i>La metodología econométrica moderna: una versión aplicada</i>, Cuadernos de trabajo, UACPyP, UNAM. • Granger, C. W. J. y P. Newbold (2001). "Macroeconometrics—Past and Future", <i>Journal of Econometrics</i>, 100. • Greenaway, D. (1995). <i>Policy Forum: Macroeconomic Modelling, Macroeconomic Forecasting and Macroeconomic Policy</i>, <i>The Economic Journal</i>, 105, July. • Hendry, D. F. (1983). "Econometric Modelling: The 'Consumption Function' in Retrospect", <i>Scottish Journal of Political Economy</i>, 30, 3, 193-220. • Hendry, D. F. y J. F. Richard (1982). "On the Formulation of Empirical Models in Dynamic Econometrics", <i>Journal of Econometrics</i>, 20, 1, 3-33. • Koopmans, T.C. (1950), "When Is an Equation System Complete for Statistical Purposes?", Chapter 17 en T. C. Koopmans (ed.) <i>Statistical Inference in Dynamic Economic Models</i> (Cowles Commission Monograph No.10), John Wiley, New York, 393-409. • Mena, H. (1994). "Acerca de la viabilidad de la investigación empírica macroeconométrica en la América Latina", <i>El Trimestre Económico</i>. Núm. 244. Vol. LXI, octubre-diciembre. FCE, México. • Mukherjee, C., H. White y M. Wuyts. (1998). <i>Econometrics and date analysis for developing countries</i>, Routledge. Londres. • Newbold, P. y C. Granger (1974). "Spurious regressions in econometrics", <i>Journal of Econometrics</i>. Num. 2. • Patinkin, D. (1976). "Keynes and Econometrics: On the Interaction between the Macroeconomic Revolution of the Interwar Period", <i>Econometrica</i>. Vol. 44, 6. • Rupra, I. y H. Sabau (1984). "Modelos econométricos para la evaluación de la política económica: una perspectiva metodológica", <i>Economía Mexicana</i>, Serie temática, Núm. 2. CIDE, México. 	
<p>Sugerencias didácticas:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Discusión grupal de trabajos de econometría aplicada a problemas económicos de México. • Exposición de problemas específicos que pueden ser abordados a través de la econometría. 	<p>Métodos de evaluación:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Asistencia puntual. • Tareas y participación en clase. • Exámenes parciales • Trabajo final: proyecto de modelación econométrica aplicada a un problema

<ul style="list-style-type: none"> • Elaboración de simulaciones econométricas en STATA, tanto con datos reales como simulados. 	<p>específico de la economía mexicana.</p>
<p>Perfil profesiográfico: Profesor con estudios de posgrado o especialización en economía aplicada y amplia experiencia docente en Análisis de Regresión Lineal y Análisis de Series de Tiempo Económicas.</p>	