



CONTENIDO ANALÍTICO

[1] IDENTIFICACIÓN

ASIGNATURA:	ECONOMETRÍA II	SIGLA:	C-116
ÁREA CURRICULAR:	CUANTITATIVAS	CICLO:	PROFESIONAL
MODALIDAD:	SEMESTRAL	NIVEL:	SEXTO SEMESTRE
PRE-REQUISITO:	C-115		

[2] OBJETIVO

Dotar de instrumentos de análisis, a través de métodos y técnicas de contrastación empírica, de la evolución temporal de las variables económicas más relevantes y el análisis de las relaciones dinámicas causales existentes entre esas variables con el propósito de realizar predicciones y llevar a cabo análisis de políticas económicas de manera de lograr destrezas para especificar, evaluar y aplicar modelos econométricos aplicados a series de tiempo, panel de datos y a datos de corte transversal.

[3] CONTENIDO

1. Modelos con tendencia

- 1.1 Definiciones básicas: proceso estocástico, estacionariedad estricta y débil.
- 1.2 Condiciones para la estacionariedad de los principales procesos.
- 1.3 Raíces unitarias en un modelo de regresión: tests de Dickey—Fuller, extensiones al test de Dickey—Fuller, contraste de Phillips-Perron — múltiples raíces — raíces Unitarias estacionales —test de raíz unitaria en presencia de quiebre estructural.
- 1.4 Problemas en testear raíces unitarias.

2. Modelos de series de tiempo multiecuacionales

- 2.1 Procesos de vectores autorregresivos (VAR)
- 2.2 Supuestos básicos y propiedades
- 2.3 Causalidad de Granger
- 2.4 Identificación de procesos VAR
- 2.5 Estimación de procesos VAR
- 2.6 Evaluación: Funciones impulso - respuesta y descomposición de varianzas
- 2.7 Predicción

3. Cointegración y modelos de corrección de equilibrio

- 3.1 Cointegración y tendencia
- 3.2 Cointegración y modelos de corrección de equilibrio
- 3.3 Tests de cointegración: Engle—Granger, Johansen: raíces características, rango, y cointegración - test de hipótesis en el contexto de cointegración
- 3.4 Modelos de rezados distribuidos autorregresivos (ADL)
- 3.5 Conceptos de exogeneidad

4. Modelos de series temporales de heteroscedasticidad

- 4.1 Modelo de Heteroscedasticidad Condicional Autorregresiva (ARCH)
- 4.2 Modelos GARCH integrados
- 4.3 Identificación, estimación y contraste de hipótesis
- 4.4 Evaluación de pronósticos.



- 4.5 Pronósticos con modelos GARCH
- 4.6 Modelos GARCH asimétricos
- 4.7 Modelos GARCH multivariados

5. Modelos con panel de datos

- 5.1 Modelos de panel de datos estáticos: modelos de efectos fijos y efectos aleatorios — test de significancia de efectos latentes
- 5.2 Estimadores entre grupos
- 5.3 Mínimos Cuadrados Generalizados
- 5.4 Contraste de efectos aleatorios
- 5.5 Test de Hausman
- 5.6 Paneles no balanceados
- 5.7 Modelos de panel de datos dinámicos

6. Econometría de corte transversal

- 6.1 El modelo de probabilidad lineal
- 6.2 Estimación Probit y Logit.
- 6.3 Modelos multinomiales y las diferentes especificaciones de la variable dependiente
- 6.4 Bondad de ajuste.
- 6.5 Variables dependientes limitadas
- 6.6 Modelos de regresión truncada
- 6.7 Modelos de regresión censurada
- 6.8 Estimación e inferencia
- 6.9 Sesgo de selección

[4] BIBLIOGRAFÍA

- Peña, D., (2005). “Análisis de Series Temporales”
- Enders, W. (2009). “Applied Econometric Time Series”
- Greene, H. William, (2011). “Econometric Analysis”
- Harris R. y Sollis R. (2003). “Applied Time Series Modelling and Forecasting”
- H. Lütkepohl, (1993). Introduction to multiple time series analysis.
- Novales, Alfonso, (1992). “Econometría”