



UNIVERSIDAD NACIONAL DEL CALLAO
FACULTAD DE CIENCIAS ECONÓMICAS
ESCUELA PROFESIONAL DE ECONOMIA

I. DATOS GENERALES

1.1	Asignatura:	Econometría II
1.2	Código:	403
1.3	Condición:	Obligatorio
1.4	Pre – requisito:	Econometría I
1.5	N° de horas de clase:	Teoria:3 Practica:2
1.6	N° de créditos:	4
1.7	Ciclo:	VII
1.8	Semestre Académico:	2018-A
1.9	Duración:	17 semanas
1.10	Profesor:	Isabel Del Carpio Alva (Coordinador) Carlos I. Palomares Palomares Enrique A. Barrientos Apumayta

II. SUMILLA

La asignatura corresponde al área de Teoría y Política Económica y es de carácter teórico-práctico. Se propone capacitar al discente en los métodos econométricos más especializados y avanzados y de modelos que sirven de herramienta fundamental para la investigación socioeconómica, en el marco del enfoque constructivista-conectivista, en transición a la formación profesional por competencias, haciendo incluso actividades de investigación en el transcurso del tratamiento de los temas. Los contenidos se desarrollarán en cuatro unidades temáticas:

1. Modelos Econométricos dinámicos y de Series de Tiempo Estocásticos
2. Modelos Econométricos de Respuesta Binaria
3. Modelos Econométricos de Datos Panel
4. Modelos Econométricos de Ecuaciones Simultaneas

III. COMPETENCIAS

Competencia General:

Diseña modelos econométricos utilizando la teoría económica y métodos cuantitativos en distintos escenarios socio económicos.

Competencias de la asignatura:

COMPETENCIA DE LA ASIGNATURA	CAPACIDADES	ACTITUDES
Diseña modelos econométricos de series de tiempo	1.CE-A:regresiona modelos econométricos de series de tiempo solucionado problemas socioeconómicos 2.CE-A:Analiza los modelos econométricos de series de tiempo 3.I-F:Propone modelos econométricos de series de tiempo	Contrastando relaciones de causalidad Valorando las propiedades de los estimadores Resolviendo casos de estudio
Diseña modelos	1.CE-A: Estima modelos de	Contratando relaciones de

económicos de respuesta binaria por el método de mínimos cuadros ordinarios y el método de máxima verosimilitud	respuesta binaria por el método de mínimos cuadros ordinarios y el método de máxima verosimilitud 2.CE-A: Analiza los modelos económicos de series de tiempo 3.I-F: Propone modelos económicos de series de tiempo	causalidad Valorando las propiedades de los estimadores Resolviendo casos de estudio
Diseña modelos económicos de datos panel	1.CE-A: Estima modelos económicos de datos panel 2.CE-A: Analiza los modelos económicos de datos panel 3.I-F: Propone modelos económicos de datos panel	Valorando las ventajas de este método Comparando entre el método de MCO, y el de efectos fijos y el de efectos fijos y el de efectos aleatorios Resolviendo casos de estudio
Diseña modelos económicos de ecuaciones simultaneas	1.CE-A: Estima modelos de ecuaciones simultaneas 2.CE-A: Analiza los modelos económicos de ecuaciones simultaneas 3.I-F: Propone modelos económicos de series de tiempo	Considerando los diferentes métodos Valorando su identificación Resolviendo casos de estudio

IV. PROGRAMACIÓN POR UNIDADES DE APRENDIZAJE

Unidad N°1: Modelos económicos Dinámicos y de series de series de tiempo Estocásticos				
Duración: 6 semanas				
Fecha de inicio: 02/04/18			Fecha de término: 11/05/18	
Capacidades de la unidad	1.C E-A regresiona modelos económicos dinámicos y de series de tiempo estocásticos solucionando problemas socioeconómicos	Reconoce los modelos económicos dinámicos y de series de tiempo estocásticos en su formulación y estimación		
	2.CE-A Analiza los modelos económicos dinámicos y de series de tiempo estocásticos	Aplica los modelos económicos de series de tiempo verificando las relaciones de causalidad		
	C IF Formula modelos económicos dinámicos y de series de tiempo estocásticos	Propone modelos económicos de series de tiempo prospectivamente		
PROGRAMACIÓN DE CONTENIDOS				
SEM	CONTENIDO CONCEPTUAL	CONTENIDO PROCEDIMENTAL	CONTENIDO ACTITUDINAL	INDICADORES de Evaluación
1	1.1 Definición de modelos dinámicos 1.2 El modelo de Koyck	1.1 con ayuda del PPT se expone la definición de los modelos dinámicos y su campo de acción 1.2 Con ayuda del PPT demuestra el modelo de	Compara críticamente los modelos dinámicos	Reconoce la definición de modelos dinámicos, la estimación del modelo de Koyck

	1.3 Extensiones del modelo de Koyck	Koyck 1.3 con ayuda del PPT demuestra las extensiones del modelo de Koyck		y sus extensiones
2	Formulación del modelo de rezago distribuido polinomial (PDL)	2.1 A partir dl PPT conoce la formulación, la estimación y los problemas de estimación de los modelos PDL	Valora la utilidad de los modelos de rezago distribuido polinomial en la investigación socioeconómica	2.1 Reconoce la formulación del y estimación de los de rezago distribuido polinomial
3	Estacionariedad de las Series de tiempo estocásticos	3.1 Con la ayuda del PPT se define las series de tiempo estacionarias y las no estacionarias 3.2 Con la ayuda del PPT se analiza las pruebas de estacionariedad	Valora conocer las series de tiempo estacionarias y las no estacionarias , Comparando críticamente las distintas pruebas de estacionariedad	Determina la estacionariedad de las series de tiempo para datos peruanos y Determina la estacionariedad de las series de tiempo para datos peruanos
4	Cointegracion y el modelo de corrección de errores	4. Con la ayuda del PPT se expone sobre cointegracion, y el modelo de corrección de errores	Valora la importancia de la cointegracion y el modelo de corrección de errores en el estudio de problemas socioeconómicos	Corroborar si dos o más series de tiempo están cointegradas
5	El modelo ARIMA	A partir del PPT conoce la formulación y estimación del modelo ARMA	Valora la importancia del modelo ARIMA en la predicción de las series de tiempo	Aplica el modelo ARIMA en el pronóstico de las series de tiempo
6	El modelo VAR	A partir del PPT conoce la formulación y estimación del modelo de vectores autorregresivos (VAR)	Valora la importancia del modelo VAR en el pronóstico de las series de tiempo	Aplica el modelo VAR en el pronóstico de las series de tiempo

Unidad N°2: Modelos econométricos de Respuesta Binaria

Duración: 4semanas

Fecha de Inicio: 14/05/18

Fecha de término:08/06/18

Capacidades de la unidad

2.CE-A Analiza los modelos econométricos de respuesta binaria
3.I-F.propone modelos econométricos de respuesta binaria

Valorando las propiedades de los estimadores
Resolviendo casos de estudio

PROGRAMACIÓN DE CONTENIDOS

SEM	CONTENIDO CONCEPTUAL	CONTENIDO PROCEDIMENTAL	CONTENIDO ACTITUDINAL	INDICADORES de Evaluación
7	7.1. Naturaleza y características de los modelos de repuesta binaria 7.2 problemas de estimación de los modelos de respuesta binaria 7.3 Estimación del modelo de probabilidad lineal(MPL)	7.1A partir del PPT conoce la naturaleza, y características de los modelos de respuesta binaria 7.2 a partir del PPT analiza los problemas de estimación de los modelos de respuesta binaria 7.3 A partir del PPT conoce la estimación del modelo MPL	Valora la utilidad de los modelos de respuesta binaria en la investigación socioeconómica	Reconoce la naturaleza , características y problemas de estimación de los modelos de respuesta binaria en las lecturas de los papers
8	EXAMEN PARCIAL			
9	Estimación del modelo Logit	A partir del PPT conoce la estimación del modelo Logit e interpreta el significado de los parámetros del modelo logit	Valora la importancia del modelo logit en el estudio de la probabilidad de ocurrencia de hechos socio económicos	Aplica el modelo logit para predecir la probabilidad de ocurrencia de las variables dependientes del modelo en estudio de casos
10	Estimación del modelo Probit	A partir del PPT conoce la estimación del modelo probit e interpreta el significado de los parámetros del modelo Probit	Compara críticamente el modelo logit y el probit	Aplica el modelo probit para predecir la probabilidad de ocurrencia de las en estudio de casos
Unidad N°3: Modelos Econométricos de datos panel				
Duración: 3semanas				
Fecha de inicio:11/06/18			Fecha de término:28/06/18	
Capacidades de la unidad		1.CE-A:regresiona modelos econométricos con datos panel solucionado problemas socioeconómicos 2.CE-A:Analiza los modelos econométricos de datos panel 3.I-F:Propone modelos econométricos con datos panel	Considerando el tipo de estimación de modelos de datos panel Comparando las ventajas de cada método de estimación Resolviendo casos de estudio	
PROGRAMACIÓN DE CONTENIDOS				
SEM	CONTENIDO CONCEPTUAL	CONTENIDO PROCEDIMENTAL	CONTENIDO ACTITUDINAL	INDICADORES de Evaluación
11	11.1 Naturaleza y características de los modelos de datos panel 11.2 Estimación de modelos de datos panel por mínimos cuadrados	11.1 A partir del PPT conoce la naturaleza y características de los modelos de datos panel 11.2 A partir del PPT conoce la estimación de los modelos de datos panel por MCO	Valora la importancia de los modelos de datos panel en la investigación socioeconómica	Reconoce las ventajas y debilidades del modelo de datos panel Examina el resultado de la estimación de modelos de

	ordinarios(MCO)			datos panel por MCO
12	12.1 Estimación de modelos de datos panel por el método de efectos fijos 12.2 Estimación del modelo de datos panel por el método de efectos fijos mediante software econométrico	13.1 a partir del PPT conoce la estimación del modelo de datos panel por el método de efectos fijos 13.2 A partir de la salida de la estimación por el Software conoce la estimación del modelo de datos panel por el método de efectos fijos	Valora críticamente el método de efectos fijos y el método de MCO en la estimación de modelos de datos panel	Aplica la estimación de modelos de datos panel por MCO y por el método de efectos fijos Comparando ambos métodos para el mismo dato
13	13.1 Estimación de modelos de datos panel por el método de efectos aleatorios 13.2 Estimación del modelo de datos panel por el método de efectos aleatorios mediante software econométrico	13.1 a partir del PPT conoce la estimación del modelo de datos panel por el método de efectos aleatorios 13.2 A partir de la salida de la estimación del Software E View conoce la estimación del modelo de datos panel por el método de aleatorios	Compara críticamente el método de efectos fijos y el método de efectos aleatorios en la estimación de modelos de datos panel, a través de la lectura de papers donde utilizan ambos métodos	Aplica la estimación de modelos de datos panel efectos fijos y por el método de efectos aleatorios Comparando ambos métodos para el mismo dato

Unidad N°4: Modelos Econométricos de Ecuaciones Simultaneas

Duración: 3semanas

Fecha de inicio:02/07/18

Fecha de término:20/07/18

Capacidades de la unidad	.CE-A: regresión modelos econométricos de ecuaciones simultaneas solucionado problemas socioeconómicos 2.CE-A:Analiza los modelos econométricos de ecuaciones simultaneas 3.I-F:Propone modelos econométricos de ecuaciones simultaneas	Considerando el tipo de modelos de ecuaciones simultaneas Valorando el tipo de identificación del modelo de ecuaciones simultaneas Resolviendo casos de estudios
--------------------------	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

PROGRAMACIÓN DE CONTENIDOS

SEM	CONTENIDO CONCEPTUAL	CONTENIDO PROCEDIMENTAL	CONTENIDO ACTITUDINAL	INDICADORES de Evaluación
14	14.1 Definición, y naturaleza de los modelos de ecuaciones simultaneas 14.2 Identificación de modelos de ecuaciones simultaneas	15.1 A partir del PPT conoce la definición y naturaleza de los modelos de ecuaciones simultaneas 15.2 A partir del PPT conoce la identificación de los modelos de ecuaciones simultaneas	Aprecia la utilidad de los modelos de ecuaciones simultaneas en el análisis de problemas socioeconómicos donde hay interdependencia entre las	Determina la identificación de los modelos de ecuaciones simultaneas en casos de estudios de investigación socioeconómica

			variables	
15	Estimación de los modelos de ecuaciones simultaneas con información incompleta	15.1 A partir del PPT conoce la estimación de modelos de ecuaciones simultaneas por métodos de estimación uniecuacionales o de información incompleta 15.2 A partir del PPT conoce la estimación de modelos de ecuaciones simultaneas por métodos de estimación con información completa	Compara críticamente las características de los métodos de estimación uniecuacionales con el método de estimación con información incompleta	Aplica la estimación de modelos de ecuaciones simultaneas información incompleta A casos de estudio
16	Estimación de los modelos de ecuaciones simultaneas con información completa	15.2 A partir del PPT conoce la estimación de modelos de ecuaciones simultaneas por métodos de estimación con información completa	Compara críticamente las características de los métodos de estimación de modelos de ecuaciones simultaneas	Aplica la estimación de modelos de ecuaciones simultaneas con información completa a casos de estudio
17	EXAMEN FINAL			

V. ESTRATEGIAS METODOLÓGICAS

5.1 Estrategias centradas en la enseñanza

- a. Organización dinámica u organizada de tipo dialogante aplicando en el debate
- b. Elaboración conjunta de herramientas y técnicas de estudio

5.2 Estrategias centradas en la enseñanza

- a. Participa activamente en panel de discusión
- b. Crea materiales didácticos para sus exposiciones

VI. ESTRATEGIAS DIDÁCTICAS

Las estrategias didácticas a seguir son las siguientes

1. Exposiciones del profesor	2. Exposiciones grupales de los estudiantes
3. Resolución de casos prácticos	4. Análisis de casos prácticos y reportes de lecturas de papers, y de clases
5. Dinámicas grupales	6. Trabajos de investigación, con datos de la economía peruana

VII. MATERIALES EDUCATIVOS Y OTROS RECURSOS DIDÁCTICOS:

- 7.1. Multimedia
- 7.2. Separata
- 7.3. Uso de plumón y pizarra
- 7.4. Centro de computo de la FCE
- 7.5. Texto-cuestionario
- 7.6. Lectura de papers

VIII. SISTEMA DE EVALUACIÓN

Unidades	Productos académicos	Código	Peso para el promedio de la unidad %	Peso para el promedio final %	Instrumento de evaluación
I	Control de lectura	CL	30%	20%	Rúbrica global
	Práctica dirigida	PD	30%		Matriz de especificación
	Caso práctico	CS	40%		Matriz analítica
II	Cuadro comparativo	CC	100%	10%	Matriz global
	EXAMEN PARCIAL	EP	20%	20%	Matriz de especificación
III	Trabajo grupal	TG	50%	20%	Matriz analítica
	Estudio de caso	EC	50%		Matriz analítica
IV	Control de lectura	CL	100%	10%	Matriz global
	EXAMEN FINAL	EF	30%	20%	Matriz de especificación

IX. BIBLIOGRAFIA

a. BIBLIOGRAFÍA BÁSICA

- Greene,W (2011) Análisis econométrico, Prentice Hall
Wooldridge, (2008) Introducción a la Econometría un enfoque moderno, Madrid, McGrw Hill
Novales, A. (2000) Econometría. Madrid, Mc Graw Hill
Gujarati,D.(2010) Econometría, México, Mc Graw Hill

b. BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTARIA

- Garcia,M,Sanz,C,B. Pérez, P. (2017) Econometría y Predicción, Madrid. Edit. Mc Graw Hill
Pérez, Cesar.(2008). Econometría Avanzada Técnicas Herramientas, Madrid, Edit. Pearson
Biorn, Erick 2016). Econometrics of Panel Data Methods and Applications. Edit. Oxford University Press

c. FUENTES CIBERNETICAS

- WWW.BCRP.gob.pe
WWW. CEPAL.org
WWW.OECD.Org
WWW. IMF.org
WWW. NBER.org

X. ANEXOS

10.1 TEMAS TRANSVERSALES

Ley N° 28478

- Ética y Seguridad
- Defensa Nacional

10.2 VALORES

A lo largo del semestre académico se desarrollará la teoría y praxis sobre los siguientes valores:

- Crítica,
- Honestidad,
- Responsabilidad,
- Riesgo
- Confianza

Bellavista, 02 de Abril de 2018