



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

**I. DATOS GENERALES**

1.1	Asignatura:	MACROECONOMETRIA	
1.2	Código:	403	
1.3	Condición:	Obligatorio	
1.4	Pre – requisito:	Econometría II	
1.5	N° de horas de clase:	Teoría: 2	Práctica: 2
1.6	N° de créditos:	03	
1.7	Ciclo:	VIII	
1.8	Semestre Académico:	2018 – A	
1.9	Duración:	17 semanas	
1.10	Profesor(a):	Mg. Alejandro Oscar Olivares Ramírez (Coordinador) Mg. Juan Manuel Rivas Castillo	

**II. SUMILLA**

Es una asignatura que corresponde al área de la Econometría, donde se utiliza y analiza una gran cantidad de datos, variables y aplicaciones, que permiten realizar casuística para la toma de decisiones de los sectores públicos y privados. Este curso está diseñado para exponer a los estudiantes a una variedad de modelos macro econométricos, en la cual se encuentran aplicaciones académicas, empresariales y ambientales. Debido a su importancia se usan herramientas econométricas aplicadas para la elaboración y resolución de modelos en economía que se relacionen con bienes y servicios en general, que tengan como consecuencia un mejor manejo de los mismos para una óptima gobernanza.

Los contenidos se desarrollaran en tres unidades temáticas:

UNIDAD I.- METODOLOGÍAS

UNIDAD II.- MÉTODOS APLICATIVOS

UNIDAD III.-NUEVOS MODELOS MACROECONOMETRICOS

**III. COMPETENCIAS**

**Competencia General:**

Analiza teorías y experiencias en el campo de las ciencias económicas y de la investigación científica críticamente para utilizar herramientas informáticas e información para el planteamiento de la teoría económica.

**Competencias de la asignatura:**

1. Analiza la aplicación de los modelos económicos básicos en situaciones de información simétrica y asimétrica.
2. Analiza las características de contratos óptimos y las variables que influyen en esas características de acuerdo al comportamiento de la información de las partes del contrato.
3. Identifica situaciones típicas en la relación agente – principal: riesgo moral, selección adversa y señalización.

<b>COMPETENCIA DE LA ASIGNATURA</b>	<b>CAPACIDADES</b>	<b>ACTITUDES</b>
Analiza la aplicación de los modelos económicos básicos en situaciones de información simétrica y asimétrica	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Identifica la información relevante.</li> <li>2. Revisa el efecto de la información en la gestión de las empresas.</li> <li>3. Investiga los artículos relacionados con los sucesos estudiados.</li> </ol>	Pondera el aporte de las teorías aprendidas contrastándolas con los resultados de estudios empíricos de la realidad.
Analiza las características de contratos óptimos y las variables que influyen en esas características de acuerdo al comportamiento de la información de las partes del contrato	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Analiza las herramientas informáticas existentes.</li> <li>2. Establece la importancia de las herramientas informáticas.</li> <li>3. Establece la relación de las herramientas informáticas y la gestión de las empresas globales.</li> </ol>	Aprueba integrar los saberes del análisis económico con los métodos cuantitativos.
Identifica situaciones típicas en la relación agente – principal: riesgo moral, selección adversa y señalización	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Recopila información de los diferentes medios virtuales para la eficiencia de la internacionalización de la empresa.</li> <li>2. Infiere el impacto de los distintos métodos de eficiencia de las empresas.</li> <li>3. Establece los niveles de internacionalización de las empresas.</li> </ol>	Valora la aplicación de las diversas teorías de la Economía en la aplicación de maximizar los beneficios de los contratos.

#### IV. PROGRAMACIÓN POR UNIDADES DE APRENDIZAJE

<b>Nombre de Unidad I: Metodologías</b>					
<b>Duración : 8</b>					
<b>Fecha de Inicio :02-04- 18</b>			<b>Fecha de término:25-05-18</b>		
<b>Logro de Unidad:</b> El estudiante tendrá la base necesaria para el estudio de conceptos y aplicaciones básicas para la Macro econometría.					
<b>Semana</b>	<b>Conocimientos</b>				
	<b>Conocimientos</b>	<b>Actividades de Aprendizaje</b>		<b>Estrategias</b>	<b>Recursos</b>
	<b>Presenciales</b>	<b>No Presenciales</b>			
<b>1</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Introducción a la macroeconomía y la econometría</li> </ul>	Conceptos y teoría	Artículo económico.	<ul style="list-style-type: none"> <li>*Exposición en clase</li> <li>*Exposición Dialogada</li> <li>*lectura de documentos especializados</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>*Libros</li> <li>*Documentos de trabajo</li> <li>*internet</li> </ul>
<b>2 – 3</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Revisión de los modelos ARIMA</li> <li>• Revisión de los modelos Volatilidad Condicional</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Metodología de los modelos</li> <li>• Casuística de modelos</li> </ul>	Casos metodológicos	<ul style="list-style-type: none"> <li>*Exposición en clase</li> <li>*Exposición Dialogada</li> <li>*lectura de documentos especializados</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>*Libros</li> <li>*Documentos de trabajo</li> <li>*internet</li> </ul>

4 – 5	<ul style="list-style-type: none"> <li>Raíces unitarias, regresiones espurias y cointegración</li> <li>Quiebres estructurales</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Metodología de los modelos</li> <li>Casuística de modelos</li> </ul>	Casos metodológicos	<ul style="list-style-type: none"> <li>*Exposición en clase</li> <li>*Exposición Dialogada</li> <li>*lectura de documentos especializados</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>*Libros</li> <li>*Documentos de trabajo</li> <li>*internet</li> </ul>
6 – 7	<ul style="list-style-type: none"> <li>Cointegración y relaciones espurias</li> <li>Bootstrap en econometría de series de tiempo</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Metodología de los modelos</li> <li>Casuística de modelos</li> </ul>	Casos metodológicos	<ul style="list-style-type: none"> <li>*Exposición en clase</li> <li>*Exposición Dialogada</li> <li>*lectura de documentos especializados</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>*Libros</li> <li>*Documentos de trabajo</li> <li>*internet</li> </ul>
8	EXAMÉN PARCIAL				

<b>Nombre de Unidad II: MÉTODOS APLICATIVOS</b>					
<b>Duración : 4</b>					
<b>Fecha de Inicio :28-05- 18</b>			<b>Fecha de término:22-06-18</b>		
<b>Logro de Unidad:</b> El estudiante tendrá la base necesaria para el estudio de modelos macro econométricos y el uso aplicativo de los modelos					
Semana	Conocimientos				
	Conocimientos	Actividades de Aprendizaje		Estrategias	Recursos
Presenciales		No Presenciales			
9 – 10	<ul style="list-style-type: none"> <li>Variables instrumentales y método generalizado de Momentos (GMM).</li> <li>Modelos VAR estructurales e identificación de choques de política (Choques monetarios, fiscales, de productividad).</li> <li>Efectos de noticias o anuncios</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Metodología de los modelos</li> <li>Casuística de modelos</li> </ul>	Casos metodológicos	<ul style="list-style-type: none"> <li>*Exposición en clase</li> <li>*Exposición Dialogada</li> <li>*lectura de documentos especializados</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>*Libros</li> <li>*Documentos de trabajo</li> <li>*Separatas</li> <li>*internet</li> </ul>
11 – 12	<ul style="list-style-type: none"> <li>El filtro de Kalman y sus aplicaciones, filtros no lineales y cadenas de Markov</li> <li>Modelos de cambios de régimen de Markov</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Metodología de los modelos</li> <li>Casuística de modelos</li> </ul>	Casos metodológicos	<ul style="list-style-type: none"> <li>*Exposición en clase</li> <li>*Exposición Dialogada</li> <li>*lectura de documentos especializados</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>*Libros</li> <li>*Documentos de trabajo</li> <li>*internet</li> </ul>

<b>Nombre de la unidad III: NUEVOS MODELOS MACROECONOMETRICOS</b>					
<b>Duración : 4</b>					
<b>Fecha de Inicio :25-06- 18</b>			<b>Fecha de término:27-07-18</b>		
<b>Logro de la Unidad:</b> El estudiante conoce y analiza las nuevas tendencias de la macroeconomía.					
<b>Sem</b>	<b>Conocimientos</b>				
	<b>Conocimientos</b>	<b>Actividades de Aprendizaje</b>		<b>Estrategias</b>	<b>Recursos</b>
<b>Presenciales</b>		<b>No Presenciales</b>			
13	<ul style="list-style-type: none"> <li>Persistencia en volatilidad: modelación e implicancias</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Metodología de los modelos</li> <li>Casuística de modelos</li> </ul>	Casos metodológicos	<ul style="list-style-type: none"> <li>*Exposición en clase</li> <li>*Exposición Dialogada</li> <li>*lectura de documentos especializados</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>*Libros</li> <li>*Documentos de trabajo</li> <li>*internet</li> </ul>
14	<ul style="list-style-type: none"> <li>Pronostico (revisión de nuevos desarrollos), papel de las encuestas en pronósticos macroeconómicos.</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Metodología de los modelos</li> <li>Casuística de modelos</li> </ul>	Casos metodológicos	<ul style="list-style-type: none"> <li>*Exposición en clase</li> <li>*Exposición Dialogada</li> <li>*lectura de documentos especializados</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>*Libros</li> <li>*Documentos de trabajo</li> <li>*internet</li> </ul>
15	<ul style="list-style-type: none"> <li>El método de panel dinámico</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Metodología de los modelos</li> <li>Casuística de modelos</li> </ul>	Casos metodológicos	<ul style="list-style-type: none"> <li>*Exposición en clase</li> <li>*Exposición Dialogada</li> <li>*lectura de documentos especializados</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>*Libros</li> <li>*Documentos de trabajo</li> <li>*internet</li> </ul>
16	<b>EXAMÉM FINAL</b>				

## V. ESTRATEGIAS METODOLÓGICAS

1. Estrategia didáctica:
  - a. Exposición
  - b. Aprendizaje colaborativo
  - c. Pregunta
  - d. Debate y discusión
  - e. Simulación
  - f. Aprendizaje basado en problemas
  - g. Contrato de aprendizaje
  
2. Estrategia de transferencia:
  - a. Análisis o comparación de teorías.
  - b. Trabajo individual y grupal.
  - c. Debate de problemas concretos.
  - d. Resolución individual de ejercicios y problemas.
  
3. Estrategia participativa de grupo:
  - a. Inicio: Aclarar objetivos, usar analogías y lluvia de ideas.

- b. Desarrollo: Usar evidencia empírica que integre el aprendizaje total, estimular la reflexión crítica.
- c. Cierre: Motivar a hacer y responder preguntas, ofrecer soluciones múltiples, o hacer resumen.

## VI. MATERIALES EDUCATIVOS Y OTROS RECURSOS DIDÁCTICOS:

Los materiales y recursos didácticos que se utilizan en el desarrollo de la asignatura son:

<b>MEDIOS INFORMÁTICOS</b>	<b>MATERIALES EDUCATIVOS IMPRESOS</b>	<b>MATERIALES DIGITALES</b>
a. Computadora b. Retroproyector c. Multimedia d. Software estadístico e. Internet f. Correo electrónico	a. Libros de texto. b. Separatas c. Artículos científicos d. Documentos de trabajo. e. Compendios estadísticos.	a. Texto digital b. Videos c. Imágenes d. Tutoriales e. Página web f. Laboratorio virtual. g. Diapositivas

## VII. EVALUACIÓN

<b>ASPECTOS</b>	<b>CRITERIOS</b>	<b>INSTRUMENTOS</b>
CONCEPTUALES	Asimila y apropia definiciones, conceptos, símbolos, etc. para analizar el uso de la información de internet y las herramientas informáticas.	1.- Prueba objetiva de respuesta combinada 2.- Mapa conceptual 3.- Prueba escrita. 4.- Monografía
PROCEDIMENTALES	Sabe cómo formular y resolver la internacionalización de las empresas globales.	1.- Análisis de los problemas y ejercicios realizados en los exámenes. 2.- Observación directa de trabajos en aula. 3.- Análisis de estudios de casos. 4.- Prácticas dirigida y calificada.
ACTITUDINALES	Valora la utilidad del uso del internet y las herramientas informáticas en la internacionalización de las empresas.	1.- Registro de anécdotas, incidentes o sucesos interesantes. 2.- Evaluación participativa del grupo. 3.- Observar cambios de conducta.

El cronograma de la evaluación continua del curso es el siguiente:

Ejemplo: En caso de utilizar 5 EP el peso de cada nota es:

<b>EVALUACIÓN</b>	<b>PESO (%)</b>	<b>ESCALA VIGESIMAL</b>
EP1	50	0,5
EP2	25	0.25
EP3	25	0.25
<b>TOTAL</b>	<b>100%</b>	<b>1.0</b>

Los pesos ponderados de los resultados de evaluación son los siguientes:

<b>EVALUACIÓN</b>	<b>PESO (%)</b>	<b>ESCALA VIGESIMAL</b>
PARCIAL	30	6
EVALUACIÓN DE	40	8

PROGRESO (EP)		
FINAL	30	6
<b>TOTAL</b>	<b>100%</b>	<b>20</b>

## VIII. Bibliografía

### 1. Bibliografía Básica

N°	AUTOR	TÍTULO	EDITORIAL	AÑO
1	William H. Greene	Econometric Anaysis – 7th Edition		2010
2	Walter Enders	Applied Econometric Time Series – 2nd Edition		2010
3	James D. Hamilton	Time Series Analysis		2012
4	Helmut Lütkepohl	Applied Time Series Econometric		2005

## IX. ANEXOS

### 8.1 TEMAS TRANSVERSALES

#### 8.1 TEMAS TRANSVERSALES

El profesor promoverá la aplicación y cumplimiento de la Ley N° 28478 y mostrará que la ética está presente en las actividades de análisis, de manera a que el país se desarrolle y alcance a ser una economía sólida, segura y con gran capacidad de influencia y capacidad de negociación en la economía internacional. Asimismo, se destacará oportunamente que la seguridad y defensa nacional contribuyen a la estabilidad macroeconómica.

#### 8.2 VALORES

Los actos y conducta del profesor y los alumnos a los largo del curso deben enmarcarse dentro de los principios de honestidad, responsabilidad, eficiencia y equidad.

Bellavista, Callao marzo del 2018