

**PROGRAMA DE ASIGNATURA**  
**Prosecución de estudios en Economía**



<b>Asignatura</b>	<b>ECONOMETRÍA II</b>	
<b>Carrera</b>	<b>Ingeniería Comercial</b>	
<b>Código</b>	351477	
<b>Créditos</b>	7 SCT	Tbjo. Directo: 6 hrs. pedag. – Tbjo. Autónomo: 4 hrs. cronolog.
<b>Nivel</b>	6º semestre	
<b>Requisitos</b>	Econometría I	
<b>Categoría</b>	Obligatorio	
<b>Área de conocimiento según OCDE</b>	Ciencias Sociales	
<b>Profesor</b>		
<b>Correo electrónico</b>		
<b>Horario</b>		
<b>Ayudante</b>		
<b>Atención Alumnos</b>		
<b>Descripción</b>	<p><b>Contribución al Perfil de Egreso</b> Este curso es la segunda asignatura de Econometría del Grado en Economía. Antes de esta asignatura los estudiantes cursan dos asignaturas de Estadística y la asignatura de Econometría I que cubren técnicas de inferencia estadística y el modelo de regresión lineal. El curso de Econometría II continúa el estudio del modelo regresión presentada en Econometría I, discutiendo su aplicación en situaciones más generales. Los nuevos conocimientos adquiridos permitirán al alumno realizar trabajos empíricos de investigación cuando se dispone de datos de series temporales y datos longitudinales. Además, se discute cómo llevar a cabo la estimación e inferencia cuando no se cumplen los supuestos básicos. La discusión teórica es complementada con ejemplos reales de trabajos empíricos, y problemas prácticos donde se analizan datos económicos reales utilizando un paquete estadístico. Esta asignatura tiene su continuación en los cursos electivos de Microeconometría y Series del Tiempo.</p>	
	<p><b>Resultado de aprendizaje general</b> Al finalizar el curso los alumnos deberán ser capaces de:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>– Conocer las técnicas econométricas intermedias para el análisis de datos.</li> <li>– Formular relaciones entre variables económicas, cuantificarlas y valorar los resultados obtenidos, en situaciones en las que no se cumplen las hipótesis básicas.</li> <li>– Evaluar a partir de un modelo econométrico las diferentes respuestas de una variable económica ante cambios de otra u otras variables.</li> <li>– Saber interpretar correctamente los resultados obtenidos al estimar un modelo en el que no se cumplen las hipótesis básicas.</li> </ul>	
	<b>Resultados de aprendizaje específicos</b>	<b>Unidades temáticas</b>
	Conocer las técnicas econométricas intermedias para el análisis de datos de series temporales.	I Análisis de regresión lineal con datos de series temporales.

<p>Conocer las técnicas econométricas intermedias para el análisis de datos longitudinales.</p>	<p>II Análisis de regresión lineal con datos longitudinales.</p>
<p>Estimar e interpretar correctamente los resultados obtenidos por modelos no lineales.</p>	<p>III Modelos no lineales.</p>
<p>Utilizar el software STATA para estimar los modelos con datos económicos (de individuos, hogares, empresas o países) y realizar hipótesis sobre los mismos.</p>	<p>IV Sesiones de laboratorio en STATA</p>
<p><b>Metodologías de enseñanza y de aprendizaje</b>  La asignatura se desarrolla en combinación de clases dictadas por el profesor, ayudantías y sesiones de laboratorio. Estas actividades se complementan con las hojas de ejercicios que se asignan durante el semestre y el material bibliográfico de referencia.  En las clases de teoría se discuten los diversos aspectos teóricos y prácticos y se formalizan los principales conceptos del curso. Se presentan las derivaciones formales y las aplicaciones para resolver los problemas específicos o contextualizados en ejemplos empíricos concretos.  Las ayudantías están centradas en la resolución de los problemas, análisis de casos prácticos con programas informáticos, y constituyen una herramienta fundamental para la preparación de las evaluaciones del curso.  Uno de los objetivos importantes del curso consiste en lograr que el alumno tenga capacidad de aplicar los modelos econométricos mediante el uso de un paquete estadístico. El software STATA es la herramienta fundamental de aprendizaje. Los diferentes conceptos se discuten en el contexto de casos de estudio en Ciencias Sociales utilizando datos reales. Los alumnos han de entregar prácticas realizadas con STATA de forma periódica.  Para el trabajo autónomo se recomienda la lectura de textos, desarrollo de hojas de ejercicios, que se asignarán durante el semestre, y revisión de contenidos vistos en cátedra. El objetivo es facilitar el proceso continuo de asimilación de los conceptos a lo largo del semestre. La solución de las hojas de ejercicios se discute durante las ayudantías.  Para aclarar dificultades con la materia del curso, se realizan consultas en horario de atención de los alumnos, a través de Intranet, por email, o solicitando una cita con el profesor.</p>	
<p><b>Procedimientos de evaluación</b>  La evaluación del alumno se realizará a partir de la consideración de los siguientes aspectos:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Examen final escrito que constará de preguntas teóricas y prácticas. Su aportación a la calificación no excederá el 50% de la nota final.</li> <li>- Examen parcial escrito que constará de preguntas teóricas y prácticas. Su aportación a la calificación no excederá el 50% de la nota final.</li> <li>- Evaluación de las actividades prácticas desarrolladas por el alumno durante el curso, a partir de trabajos elaborados, exposiciones orales, problemas resueltos y/o resultados de los controles.</li> </ul>	
<p><b>Bibliografía básica</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Wooldridge, Jeffrey M. (2010). Introducción a la Econometría. Un Enfoque Moderno. México, DF: Cengage Learning. Cuarta Edición en Español.</li> <li>- Stock, James H, Watson, Mark M. (2012). Introducción a la Econometría. Pearson Educación S.A. Madrid. Tercera Edición en Español.</li> </ul>	

## Apéndice

<b>Contenidos Detallados</b>	<p><b>Tema 1. Introducción al análisis de regresión lineal con datos de series temporales</b></p> <ol style="list-style-type: none"><li>1. Introducción a series temporales. Series temporales estacionarias y débilmente dependientes. Ejemplos de procesos estocásticos. Predicciones.</li><li>2. Estimación de MCO. Propiedades de los estimadores MCO.</li><li>3. Modelos estáticos y de retardos distribuidos finitos.</li><li>4. Formas funcionales. Variables ficticias. Tendencia y estacionalidad.</li></ol> <p><b>Tema 2. Autocorrelación en regresiones con series temporales</b></p> <ol style="list-style-type: none"><li>1. Propiedades del estimador MCO con errores autocorrelacionados.</li><li>2. Contrastes de autocorrelación.</li><li>3. Inferencia robusta con MCO.</li><li>4. Solución a la autocorrelación con regresores estrictamente exógenos: MCG y MCGF.</li></ol> <p><b>Tema 3. Introducción al análisis de política económica con datos longitudinales</b></p> <ol style="list-style-type: none"><li>1. Modelos con datos combinados de secciones cruzadas repetidas.</li><li>2. Análisis de política económica con datos combinados de secciones cruzadas repetidas.</li><li>3. Introducción a los datos de panel. Estimación de MCO. Modelos de efectos aleatorios y de efectos fijos.</li><li>4. Análisis de política económica con datos de panel.</li></ol> <p><b>Tema 4. Modelos para respuesta binaria</b></p> <ol style="list-style-type: none"><li>1. Introducción. Variable dependiente binaria. Modelo de probabilidad lineal.</li><li>2. Especificación de los modelos logit y probit para respuestas binarias.</li><li>3. Interpretación de las estimaciones logit y probit.</li><li>4. Estimación por máxima verosimilitud de los modelos logit y probit.</li><li>5. Contrastes de hipótesis múltiples.</li></ol> <p><b>Tema 5. Modelos para variable dependiente limitada y de selección muestral</b></p> <ol style="list-style-type: none"><li>1. Introducción. Variables censuradas y truncadas.</li><li>2. Solución de esquina y el modelo Tobit.</li><li>3. Modelo de regresión truncada.</li><li>4. Corrección del sesgo de selección muestral.</li></ol> <p><b>Tema 6. Modelos de ecuaciones simultáneas</b> (<i>Condicional al tiempo disponible</i>)</p> <ol style="list-style-type: none"><li>1. Introducción. Sesgo de simultaneidad en MCO.</li><li>2. Identificación y estimación de sistema de dos ecuaciones.</li><li>3. Identificación y estimación de sistema con más de dos ecuaciones.</li></ol>
----------------------------------	--

	<p>4. Modelos de ecuaciones simultáneas con series de tiempo.</p> <p>5. Modelos de ecuaciones simultáneas con datos de panel.</p>		
<b>Bibliografía detallada</b>	<p><b>Tema 1. Introducción al análisis de regresión lineal con datos de series temporales</b>  <b>Wooldridge</b>, capítulo 10, secciones 10.1-10.5.; capítulo 11, sección 11.1, <b>Stock y Watson</b>, capítulos 14 y 15, secciones 14.1-14.3, 14.5, 15.1-15.3</p> <p><b>Tema 2. Autocorrelación en regresiones con series temporales</b>  <b>Wooldridge</b>, capítulo 12, secciones 12.1-12.3 y 12.5, <b>Stock y Watson</b>, capítulo 15, secciones 15.3, 15.5.</p> <p><b>Tema 3. Introducción al análisis de política económica con datos longitudinales</b>  <b>Wooldridge</b>, capítulo 13, secciones 13.1-13.5; capítulo 14, secciones 14.1-14.2, <b>Stock y Watson</b>, capítulo 10.</p> <p><b>Tema 4. Modelos para respuesta binaria</b>  <b>Wooldridge</b>, capítulo 7, sección 7.5; capítulo 17, sección 17.1, <b>Stock y Watson</b>, capítulo 11.</p> <p><b>Tema 5. Modelos para variable dependiente limitada y de selección muestral</b>  <b>Wooldridge</b>, capítulo 17, secciones 17.2-17.5.</p> <p><b>Tema 6. Modelos de ecuaciones simultáneas</b>  <b>Wooldridge</b>, capítulo 16, secciones 16.1-16.6.</p>		
<b>Evaluaciones</b>	<b>EVALUACIÓN</b>	<b>POND.</b>	<b>FECHA</b>
	Primera Prueba Parcial (Calendarizada como "1ª PEP").	35%	Por fijar por el Departamento
	Controles	10%	Fechas a fijar por el profesor
	Resumen del artículo	15%	Fechas a fijar por el profesor
	Examen (Calendarizado como "2ª PEP").	40%	Por fijar por el Departamento
	<b>EN CASO DE INASISTENCIA A ALGUNA PRUEBA, DEBIDAMENTE JUSTIFICADA POR EL CONDUCTO REGULAR, LA PONDERACIÓN DE LA PRUEBA NO RENDIDA PASARÁ AL EXAMEN.</b>		