



ECONOMETRÍA II

I. DATOS GENERALES

1-Código	:	140076
2-Pre- Requisito	:	Econometría I
3-Créditos	:	04
4-Horas	:	04 horas
5-Semestre académico	:	2016-I
6-Ciclo	:	VIII

II. SUMILLA

El curso pretende que los participantes aprendan un conjunto avanzado de elementos conceptuales y prácticos del enfoque econométrico necesarios para una correcta interpretación de los resultados de la investigación econométrica aplicada. Así como, una evaluación de la pertinencia y grado de validez de las hipótesis económicas referidas a la relación entre variables de carácter económico, los datos disponibles y la observación de la realidad económica actual dentro de un enfoque integral (cuantitativo-cualitativo).

III. COMPETENCIAS GENERALES

- Conocimientos sobre el área de estudio y la profesión.
- Habilidades para buscar, procesar y analizar información procedente de fuentes diversas.
- Capacidad de aprender y actualizarse permanentemente.
- Capacidad de comprensión de un segundo idioma.
- Capacidad de investigación.
- Capacidad crítica y autocrítica.
- Capacidad para identificar, plantear y resolver problemas.
- Capacidad de trabajo en equipo.

IV. COMPETENCIAS ESPECÍFICAS

- Conoce, explica y aplica el enfoque econométrico de las series temporales y modelos no lineales a la realidad económica peruana.
- Conoce, explica y aplica el enfoque econométrico de los modelos dinámicos y de volatilidad a la realidad económica peruana.
- Conoce, explica y aplica el enfoque econométrico de los modelos de panel data y de elección cualitativa con microdatos de la realidad económica peruana.

- Conoce, explica y aplica técnicas avanzadas de la estadística en el ámbito de la investigación econométrica con microdatos de la realidad económica peruana.

V. PROGRAMACIÓN DE CONTENIDOS

UNIDAD I			
TRATAMIENTO DE SERIES TEMPORALES Y MODELOS NO LINEALES			
SEMANA	CONCEPTUAL	PROCEDIMENTAL	ACTIVIDAD DE APRENDIZAJE
1	Series de Tiempo univariadas <ul style="list-style-type: none"> - Definición, alcance y restricciones del enfoque econométrico de series de tiempo univariadas. - Fundamentos matemáticos del enfoque matricial y su relación con el enfoque econométrico de series de tiempo. - Fundamentos Estadísticos y el enfoque econométrico de las series de tiempo. - La teoría económica (macro y micro, finanzas y economía aplicada) y enfoque econométrico de series de tiempo. 	Reconoce el grado de relación entre el enfoque econométrico de series de tiempo y otras disciplinas económicas y no económicas. Relaciona el instrumental matemático y estadístico y el enfoque econométrico de las series de tiempo con el análisis económico.	Prueba de entrada
			Elaboración de Mapas Conceptuales.
			Elaboración de hipótesis tentativas de la realidad económica actual.
			Dinámica Grupal de caso de aplicación en laboratorio.
2	Modelos Econométricos de Series de Tiempo <ul style="list-style-type: none"> - Conceptualización de Modelos Autoregresivos univariantes. - Conceptualización de Modelos de Medias Móviles de la perturbación estocástica. - Conceptualización de Modelos integrados Univariantes. 	Relaciona las variables económicas con su uso econométrico dentro de un modelo econométrico de series de tiempo integrado. Correlaciona hipótesis económica con hipótesis econométricas dentro de la realidad económica actual.	Exposición magistral (PPT)
			Dinámica en Equipo Trabajo colaborativo en Laboratorio.
3	Modelo Econométrico No Lineal <ul style="list-style-type: none"> - Supuestos Básicos del MNL - Variable Estocástica y fundamento del Enfoque Econométrico. - La No linealidad y la teoría económica. 	Reconoce los supuestos econométricos y económicos de un modelo econométrico no lineal. Comprende las limitaciones del uso científico del modelo no lineal en la ciencia económica.	Trabajo en equipo
			Prepara un mapa conceptual donde identifica el rol del MNL e I en la ciencia económica en laboratorio.

4	Aplicaciones del MNL y MI <ul style="list-style-type: none"> - En la macroeconomía. - En la microeconomía. - En la economía financiera. - en otras disciplinas económicas y afines. 	Reconoce los diferentes usos y aplicaciones del modelo no lineal e integral. Identifica el grado de comprobación de la hipótesis económica con ayuda de la técnica econométrica del modelo no lineal e integrado.	Control de lectura Elabora un esquema comparativo sobre las aplicaciones del MNL e I en el campo de la economía, administración y afines en laboratorio.
	EVALUACIÓN PARCIAL 1		

UNIDAD II MODELOS DINÁMICOS Y DE VOLATILIDAD AVANZADOS			
SEMANA	CONCEPTUAL	PROCEDIMENTAL	ACTIVIDAD DE APRENDIZAJE
5	Modelos dinámicos y Rezados distribuidos <ul style="list-style-type: none"> - Conceptualización de los modelos dinámicos y rezagos distribuidos en la ciencia económica. - Tipología y diversidad de uso en el campo de la microeconometría y macroeconometría. 	Analiza la importancia de los modelos dinámicos y rezagos distribuidos en el campo aplicado de la ciencia económica mediante casos aplicados.	Elaboración de Mapas Conceptuales.
			Desarrolla Casuística en laboratorio con software econométrico.
6	Modelos de Volatilidad Estocástica <ul style="list-style-type: none"> - Conceptualización de la volatilidad estocástica. - Razones económicas para la aparición de la volatilidad económica. - Naturaleza econométrica de la volatilidad en relación a la hipótesis econométrica. 	Reconoce mediante casos aplicados la importancia y relevancia de predecir la volatilidad con modelos econométricos. Evalúa la importancia de controlar y predecir la volatilidad con modelos en el trabajo econométrico de campo con información económica de la realidad peruana.	Exposición magistral (PPT)
			Dinámica en Equipo Trabajo colaborativo en software econométrico.

7	Modelo VAR y Cointegración <ul style="list-style-type: none"> - Conceptualización del modelo VAR. - Conceptualización de la cointegración - Importancia en la ciencia económica de la cointegración económica y modelos VAR en la investigación econométrica. 	Reconoce la importancia de la cointegración y modelos VAR en el campo de la investigación econométrica aplicada mediante casos aplicados. Aplica en la formulación de hipótesis económicas con restricciones no lineales en el ámbito de la investigación econométrica aplicada con datos peruanos.	Trabajo en equipo. Desarrolla casos aplicativos grupales en pares en laboratorio.
	Modelo de Corrección de Errores. <ul style="list-style-type: none"> - Conceptualización del modelo de corrección de errores. - Importancia del modelo de corrección de errores en la investigación econométrica aplicada y la ciencia económica. 	Reconoce la importancia del modelo de corrección de errores en el campo de la investigación econométrica aplicada mediante casos aplicados. Aplica en la formulación de hipótesis económicas con inexistencia de la cointegración económica en el ámbito de la investigación econométrica aplicada con datos peruanos.	Control de lectura Desarrolla casos aplicativos grupales en pares en laboratorio.
EVALUACIÓN PARCIAL 2			

UNIDAD III			
MODELO DE PANEL DE DATOS Y ESTIMACIÓN CUALITATIVA CON MICRODATOS			
SEMANA	CONCEPTUAL	PROCEDIMENTAL	ACTIVIDAD DE APRENDIZAJE
9	Modelo de Panel Data <ul style="list-style-type: none"> - Supuestos Básicos del Panel Data - Variable Estocástica y fundamento del Enfoque Econométrico con causalidad múltiple de información completa e incompleta. - La multi-linealidad y la teoría económica a nivel micro, regional o multifactorial. 	Reconoce los supuestos econométricos y económicos de un modelo econométrico Panel Data. Comprende las limitaciones del uso científico del modelo de Panel Data en la ciencia económica.	Trabajo en equipo.
			Desarrollo de Ejercicios y Monografías de Investigación econométrica aplicada.

10	Modelos de Estimación Cualitativa <ul style="list-style-type: none"> - Modelos Probit, Logit, y Tobit. - Aplicación de variables aproxy en investigación econométrica. - Estimadores de máxima verosimilitud y variables cualitativas. 	Reconoce los modelos econométricos de estimación cualitativa mediante casos aplicados.	Exposición magistral (PPT)
		Comprende las limitaciones del uso científico del modelo de estimación cualitativa en la ciencia económica con vicios econométricos. Reconoce y aplica las ventajas de los estimadores de MV con variables aproxy.	Dinámica en Equipo Trabajo colaborativo en software econométrico con casos prácticos en laboratorio.
11	Modelación de Micro Datos <ul style="list-style-type: none"> - Conceptualización de microdatos y su uso en la investigación econométrica. - Importancia de los microdatos en la formulación de hipótesis económicas y su correlación con la investigación econométrica. 	Reconoce la relevancia de los microdatos en la formulación de tesis en economía aplicada.	Trabajo en equipo.
		Comprende las limitaciones del uso científico de la modelación econométrica de microdatos en la ciencia económica. Aplica las técnicas econométricas para salvar la imposibilidad de investigación económica por deficiencia de información validando la investigación con el uso de microdatos.	Desarrolla casos aplicativos grupales en pares de reconocimiento y evaluación de los microdatos. Elabora un esquema comparativo y resuelve ejercicios y casos prácticos en laboratorio.
12	Aplicación del Estudio de Micro Datos <ul style="list-style-type: none"> - Conceptualización de Encuesta Nacional de Hogares. - Modelación econométrica con micro datos del ENAHO y ENNIV. - Relevancia de la estimación econométrica con datos del ENAHO. 	Reconoce la importancia del empleo de la técnica de los mínimos cuadrados generalizados.	Control de lectura
		Comprende las limitaciones del uso científico de los microdatos del ENAHO en la ciencia económica.	Desarrolla casos aplicativos grupales en pares de reconocimiento y levantamiento hipótesis económicas con los datos del ENAHO. Elabora un esquema comparativo y resuelve ejercicios y casos prácticos en laboratorio.

EVALUACIÓN PARCIAL 3

UNIDAD IV			
TÉCNICAS AVANZADAS DE ESTADÍSTICA EN INVESTIGACIÓN ECONOMETRICA			
SEMANA	CONCEPTUAL	PROCEDIMENTAL	ACTIVIDAD DE APRENDIZAJE
13	Análisis de Conglomerados <ul style="list-style-type: none"> - Conceptualización del análisis de conglomerados (clúster). - Relevancia del problema de identificación en la investigación econométrica aplicada. - Planteamiento de hipótesis económicas de causalidad simultánea y la investigación econométrica aplicada. 	Reconoce los supuestos econométricos y económicos de un análisis de conglomerados. Comprende las limitaciones del uso científico del análisis de conglomerados en la ciencia económica.	Elaboración de Mapas Conceptuales.
			Desarrollo de Ejercicios y Monografías de Investigación.
			Desarrollo de Aplicaciones en laboratorio
14	Análisis discriminante <ul style="list-style-type: none"> - Conceptualización del análisis discriminante. - Construcción de modelos con la expectativa de discriminar el comportamiento económico observado con un criterio estadístico. - Relevancia e importancia del análisis discriminante de las variables económicas en la investigación econométrica aplicada. 	Reconoce la importancia del empleo de la técnica del análisis discriminante. Comprende las limitaciones del uso científico del análisis discriminante en la ciencia económica. Aplica las técnicas econométricas como el modelo autoregresivo para salvar los vicios econométricos validando la investigación econométrica aplicada.	Exposición magistral (PPT)
			Dinámica en equipo
			Trabajo colaborativo en software econométrico
15	Análisis de Fiabilidad y supervivencia <ul style="list-style-type: none"> - Conceptualización del análisis de fiabilidad y supervivencia. - Construcción de modelos con el enfoque de fiabilidad y supervivencia en el ámbito financiero y económico. 	Reconoce la importancia del empleo de la técnica del análisis de fiabilidad y supervivencia. Comprende las limitaciones del uso científico del análisis de fiabilidad y supervivencia en la ciencia económica con vicios econométricos.	Trabajo en equipo.
			Desarrolla casos aplicativos grupal en pares en laboratorio.

	- Relevancia e importancia en el tratamiento de la técnica del análisis de supervivencia y fiabilidad en la investigación econométrica aplicada.	Aplica las técnicas econométricas para salvar la dificultad de la investigación econométrica por la insuficiencia de la información económica.	
16	Investigación Econométrica Aplicada - Presentación y sustentación de la investigación econométrica aplicada.	Elabora y expone trabajo monográfico.	Hace uso de la herramienta APA presente en el Word.
EVALUACIÓN FINAL			

VI. ESTRATEGIAS METODOLOGICAS

Lecturas

Las lecturas contenidas en el Aula Virtual deben ser leídas previamente. Se tomarán controles de lecturas referidos a ellas. Es importante leer los materiales asignados para cada sesión, de manera que se pueda complementar el tratamiento de los mismos en clase de laboratorio.

Casos y ejercicios

A lo largo del curso se desarrollarán casos aplicativos además el estudio de los conceptos teóricos será complementado con ejercicios y pequeñas investigaciones a ser evaluadas de forma continua como trabajos asignados en Aula Virtual.

Participación en clase

La participación en clase es de primera importancia en el curso, la participación incluye no solamente los aportes referidos al tema a tratar, sino las preguntas que surgieran con referencia a él. Así como el desarrollo de las tareas asignadas en laboratorio como evaluación continua.

Trabajo grupal en investigación econométrica aplicada

En particular, se deberán conformar equipos de trabajo de seis integrantes (como máximo por equipo). Cada equipo deberá desarrollar y diseñar un investigación econométrica con las herramientas alcanzadas en clase. Desde la décima semana se propone asesorías y orientaciones de trabajo en el aula para revisar los avances, ideas preliminares, dificultades, entre otros, que puedan afectar el desarrollo de su proceso de investigación.

VII. MATERIALES EDUCATIVOS Y OTROS RECURSOS DIDÁCTICOS

- Equipos: Pizarra, equipo multimedia, plumones.

- Materiales: Separatas, lecturas, casos de estudio, dinámicas seleccionadas, software econométrico y sus respectivos manuales.
- Medios electrónicos: Web sites relacionadas a la asignatura, videos, laboratorio y Aula Virtual.

VIII. EVALUACIÓN

El promedio final de curso es producto de una media ponderada que considera los siguientes pesos:

• Evaluación Parcial 1	10%
• Evaluación Parcial 2	20%
• Evaluación Parcial 3	20%
• Evaluación Final	30%
• Evaluación Continua	20%

IX. BIBLIOGRAFÍA

- GUJARATI, Damodar N.; PORTER, Dawn C. 2010. "Econometría". Editorial Mcgraw Hill. 5ta. Edición. México.
- STOCK, J.H. y WATSON, M.M. "Introducción a la Econometría", 3ª Edición, Pearson, 2012.