



# UNIVERSIDAD NACIONAL DE SAN CRISTOBAL DE HUAMANGA

(Segunda Universidad Fundada en el Perú)  
FACULTAD DE CIENCIAS ECONOMICAS, ADMINISTRATIVAS Y  
CONTABLES  
ESCUELA DE FORMACIÓN PROFESIONAL DE ECONOMIA

## I. DATOS GENERALES

ASIGNATURA:	EC 441 Econometría I
REQUISITOS:	EC 346 Estadística para Economistas II
PERÍODO ACADÉMICO:	2020-I
PLAN DE ESTUDIOS	2004-R Reajustado
PROFESORES:	JUAN ALBERTO HUARIPUMA VARGAS
E-mail	WILLIAN DANTE CANALES MOLINA

## II. SUMILLA

Naturaleza de la econometría. Modelo lineal general. Violación de los supuestos del modelo clásico: Multicolinealidad. Heterocedasticidad y Autocorrelación. Modelos de regresión con variables independientes dicótomas. Modelos econométricos dinámicos: Modelos autorregresivos y modelos de rezagos distribuidos. Modelos de ecuaciones simultáneas: Identificación y métodos de estimación.

## III. OBJETIVO

Al finalizar el desarrollo de la asignatura, los alumnos que correspondan a las exigencias del mismo, estarán en condiciones de:

- a) Conocer y aplicar las técnicas básicas del análisis econométrico clásico.
- b) Utilizar a un nivel intermedio el software Eviews y Stata
- c) Realizar trabajos de investigación de naturaleza empírica.

## IV. PROGRAMA ANALITICO

### CAPITULO I: El Modelo Lineal General

1ª. - 3ª. Semana: Especificación del modelo. Estimación. Propiedades. Inferencia estadística. Coeficientes de correlación parcial y coeficiente de determinación múltiple. Predicción. Aplicaciones utilizando EXCEL, SPSS, EIEWS y STATA. Primera evaluación parcial.

### CAPITULO II: Multicolinealidad, Heterocedasticidad y Autocorrelación

4ª. - 5ª. Semana: Naturaleza, estimación y consecuencias

6ª. - 7ª. Semana: Detección, medidas remediales y aplicaciones utilizando EXCEL, EIEWS y STATA.

### **CAPITULO III: Modelos con variables independientes y dependientes cualitativas**

8ª. - 9ª. Semana: regresión con variables dicotómicas dependientes

10ª - 11ª. Semana: Aplicaciones utilizando EXCEL, SPSS, EVIEWS y STATA.

### **CAPITULO IV: Diseño de Modelos Econométricos**

12ª. Semana: Sobre la modelización econométrica: errores de especificación y medición  
Selección de Modelos: Enfoque de Learner, Hendry, pruebas alternativas y aplicaciones utilizando EXCEL, EVIEWS y STATA.

### **CAPITULO V: Modelos Econométricos Dinámicos**

13ª. 14ª. Semana: Modelos de retardos distribuidos y Modelos Autorregresivos. Aplicaciones utilizando EXCEL, EVIEWS y STATA.

### **CAPITULO VI: Modelos de Ecuaciones Simultáneas**

15ª. - 16ª Semana: Identificación y Estimación. Aplicaciones utilizando EVIEWS y STATA.  
Evaluación Final.

## **V. METODOLOGIA**

### **a) Actividades de aprendizaje**

Para el logro de los objetivos de la asignatura los alumnos están en la obligación de:

- ☐ Resolver los ejercicios propuestos del texto de Gujarati (2004)
- ☐ Hacer el seguimiento del contenido del libro de Carrascal (2001)

### **b) Procedimientos didácticos**

El profesor para el desarrollo del curso:

- ☐ Explicará, con detalle, los temas de cada capítulo.
- ☐ Deducirá, con detalle, las formulas a utilizar
- ☐ Utilizará información hipotética y real para mostrar la importancia de la asignatura.

### **c) Equipos de enseñanza**

Para el logro de los objetivos de cada capítulo se hará uso de:

- ☐ Microcomputadoras personales, que nos permitirá realizar las prácticas correspondientes y obviamente prescindir de cálculos tediosos y extensos.
- ☐ Plataforma virtual Google Classroom y Google meet

## **VI. SISTEMA DE EVALUACION**

### **a) Criterios y procedimientos de evaluación**

La nota aprobatoria es de once que será el resultado del promedio de los siguientes aspectos:

<input type="checkbox"/> Evaluación parcial	20%
<input type="checkbox"/> Evaluación final	20%
<input type="checkbox"/> Promedio de prácticas y controles de lectura	30%
<input type="checkbox"/> Trabajo de investigación empírica	30%

#### **b) Calendario de evaluación**

La fecha de los exámenes coincidirá con el siguiente cronograma:

<input type="checkbox"/> Primera evaluación parcial	Al final del Capítulo III
<input type="checkbox"/> Segunda evaluación parcial	Al final del capítulo VI

#### **c) Examen de aplazados**

La nota del examen de aplazados será el resultado del promedio de los siguientes aspectos:

<input type="checkbox"/> Evaluación escrita	70%
<input type="checkbox"/> Trabajo de investigación empírica	30%

### **VII. REFERENCIA BIBLIOGRAFICA**

- ☐ Alonso Antón, A., J. Fernández Macho e I. Gallastegui Zulaica (2005). *Econometría*. Madrid: Pearson Educación.
- ☐ Carrascal, U., Y. Gonzáles y B. Rodríguez (2001). *Análisis Econométrico con Eviews*. Madrid: Alfaomega Ra-Ma.
- ☐ Castro, J. F. y R. Rivas-Llosa (2003). *Econometría Aplicada*. Lima: Centro de Investigación de la Universidad del Pacífico.
- ☐ Goldberger, A.S. (2001). *Introducción a la Econometría*. Barcelona: Ariel Economía.
- ☐ Gujarati, D. (2004) *"Econometría"* McGraw-Hill, Cuarta Edición
- ☐ Greene, William H. (1997) *"Análisis Econométrico"* Editorial Prentice Hall
- ☐ Jan Kmenta (1980) *"Elementos de Econometría"* Ediciones VICENS VIVES S.A.
- ☐ Johnston y Dinardo (2001) *"Métodos de Econometría"* Editorial Vicens Vives
- ☐ Koutsoyiannis, A. (1977) *"Theory of Econometric"* Ed. McGraw Hill
- ☐ Intrilligator, M. (1990). *Modelos Económicos: Técnicas y Aplicaciones*. México: Fondo de Cultura Económica.
- ☐ Maddala, G. S. (1996) *"Econometría"* Ed. McGraw Hill, Segunda edición.
- ☐ Novales Cinca, Alfonso (1993) *"Econometría"* Ed. McGraw Hill.
- ☐ Sosa Escudero, W., (2002) *"An Introduction to Applied Econometrics"* notas de clase, University of Illinois at Urbana-Champaign.
- ☐ Wooldridge, J., (2008) *"Introductory Econometrics: A Modern Approach"* SouthWestern College Publishers, New York. Existe versión en castellano.