

Universidad Autónoma de Nuevo León

Facultad de Economía

División de Posgrado

Septiembre/Diciembre 2015

Econometría II

Edgar M. Luna Domínguez

Correo Electrónico: edgar.lunadmz@uanl.edu.mx

Oficina: Cubículo 9

Horas de Oficina: Martes y Jueves de 10:00 a 11:00 o con cita.

Objetivos del Curso.

Este curso familiariza al estudiante con los conceptos teóricos y las técnicas empíricas para el estudio econométrico de series de tiempo, paneles de datos y otros modelos econométricos, poniendo especial atención en su aplicación computacional utilizando los programas Eviews y Stata.

Libros de Texto.

- Maddala, G.S. “Introduction to Econometrics”. Ed. Wiley, 3th edition (M).
- Wooldridge, J.M. “Introductory Econometrics, A Modern Approach” Ed. Thomson, 3th edition (W).
- Greene, W.H. “Econometric Analysis”. Ed. Pearson. 6th edition (G).
- Davison, R. and J.G. MacKinnon. “Econometric Theory and Methods”. Oxford University Press (libro de referencia).
- Hamilton, J.D. “Time Series Analysis”. Princeton University Press, 1ª edición (libro de referencia).
- Wooldridge, J.M. “Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data” MIT Press, 1ª edición (libro de referencia).

Evaluación.

Para la evaluación del curso se aplicará un examen parcial y un examen final acumulativo.

La ponderación de los exámenes es la siguiente:

Examen Parcial 30% (15 de Octubre).

Examen Final 40% (4 de Diciembre).

Tareas 15%.

Trabajo Final 15% (24 y 26 de Noviembre) .

Contenido del Curso.

- Mínimos Cuadrados Ordinarios
 - Repaso
 - Multicolinearidad (M-7)
 - Heteroscedasticidad (M-5) (W-8)
 - Autocorrelación (M-6.1 a 6.9) (W-12) (G-19)
 - Variables Instrumentales (M-11.5) (W-15.1 a 15.5) (G-12)

- Series de tiempo:
 - Estacionarias y No Estacionarias (M-13.1 a 13.3) (G-21.2 y 22.2)
 - Modelos Aleatorios, Promedio Móviles y Autoregresivos (M-13.4 a 13.7)
 - Raíces unitarias y pruebas para raíces unitarias (M-14.1, 14.4 y 14.5) (W-18.1 a 18.3)
 - Vectores autoregresivos: o Modelos VAR (M-14.2, 14.3 y 14.8) (G-20.6)
 - Cointegración y pruebas para cointegración (M-14.6, 14.7 y 14.10) (W-18.4 y 18.6) (G-22.3)

- Panel de datos:
 - Efectos Fijos (M-15.2) (W-14.1) (G-9.4)
 - Efectos aleatorios (M-15.3 y 15.4) (W-14.2) (G-9.5)

- Modelo SUR (M-15.5) (G-10.2)
- Coeficientes fijos y aleatorios (M-15.7) (G-9.8)

- Otros Modelos Econométricos:
 - Modelos de Elección Binaria (M-8.1 a 8.10) (W-7 y 17.1) (G-23.1 a 23.4)
 - Modelos de Elección Múltiple Discreta (G-23.9 a 23.11)
 - El Método de Máxima Verosimilitud (M-16.1 y 16.2) (G-16)
 - Modelos Censurados y Truncados (M-8.11) (W-17.2 y 17.4) (G-24)
 - Modelos de Ecuaciones Simultáneas (M-9.1 a 9.7) (W-16) (G-13)
 - Modelos de Duración o Supervivencia (G-25.6)
 - Métodos para Muestras Pequeñas: Jackknife y Bootstrap (M-17.3 a 17.6) (G-17.6)