UNIVERSIDAD NACIONAL DE SAN AGUSTÍN DE AREQUIPA

VICERRECTORADO ACADÉMICO

FACULTAD DE ECONOMIA

DEPARTAMENTO ACADÉMICO DE E C O N O M I A

SÍLABO 2022 - B

ASIGNATURA: ECONOMETRIA 2

1. INFORMACIÓN ACADÉMICA

Periodo académico:	2022 - B	
Escuela Profesional:	ECONOMÍA	
Código de la asignatura:	1703238	
Nombre de la asignatura:	ECONOMETRIA 2	
Semestre:	VI (sexto)	
Duración:	17 semanas	
Número de horas (Semestral)	**Teóricas:**	3.00
	Prácticas:	2.00
	Seminarios:	0.00
	Laboratorio:	0.00
	Teórico-prácticas:	0.00
Número de créditos:	4	
Prerrequisitos:	ECONOMETRIA 1 (1703134)	

2. INFORMACIÓN DEL DOCENTE, INSTRUCTOR, COORDINADOR

DOCENTE	GRADO ACADÉMICO	DPTO. ACADÉMICO	HORAS	HORARIO
CHOQUE LUZA, FERNANDO		E C O N O M I A	0	Mié: 11:30-14:00 Jue: 09:40-11:30
PERALTA CALCINA, JONNE		E C O N O M I A	0	Mar: 14:00-16:40 Jue: 16:40-18:30
PERALTA CALCINA, JONNE		E C O N O M I A	0	Mar: 18:30-21:00 Jue: 14:50-16:40
ROJAS LOPEZ, JOSE	MAGISTER	E C O N O M I A	0	Mar: 14:50-16:40 Jue: 14:00-16:40

3. INFORMACIÓN ESPECIFICA DEL CURSO (FUNDAMENTACIÓN, JUSTIFICACIÓN)

La asignatura de Econometría 2, aporta al logro del perfil del egresado, en la medida que desarrolla

habilidades y destrezas en los estudiantes de Economía y Finanzas, para utilizar y aplicar herramientas y metodologías econométricas que le permitan comprender el comportamiento de los fenómenos económicos, analizar con sentido crítico y reflexivo investigaciones econométricas y consecuentemente, generar aprendizajes y habilidades para predecir el impacto de los acontecimientos económicos en la toma de decisiones.

4. COMPETENCIAS/OBJETIVOS DE LA ASIGNATURA

? Competencias Generales

Desarrolla modelos econométricos en base a técnicas cuantitativas y cualitativas mediante la utilización de sistemas informáticos y TICs para la comprobación de los modelos y teoría económica, participando activamente en equipo, mostrando interés con ética y responsabilidad.

? Competencias Específicas

? Comprende la importancia de los supuestos empleados en la especificación de un modelo econométrico

? Diferencia distintos métodos de estimación y evalúa su uso de acuerdo a las características de las variables económicas de interés para obtener resultados fiables.

5. CONTENIDO TEMATICO

PRIMERA UNIDAD

Capítulo I: Teoría de la regresión lineal con regresor único

Tema 01: Análisis de Regresión Múltiple ? MCO asintóticos (SW17)

Capítulo II: Teoría de la regresión múltiple

Tema 02: Análisis de Regresión Múltiple: Inferencia (SW18)

Tema 03: Análisis de la Regresión Múltiple: Métodos de pruebas de la Correlación Serial

SEGUNDA UNIDAD

Capítulo III: Combinación de cortes transversales en el tiempo y métodos simples para datos panel

Tema 04: Métodos Simple para Datos Panel (JMW13)

Capítulo IV: ANÁLISIS DE REGRESIÓN CON DATOS PANEL

Tema 05: Regresión con datos Panel (SW10)

Tema 06: Métodos avanzados para datos panel (JMW14)

Capítulo V: MODELOS DE ECUACIONES SIMULTÁNEAS

Tema 07: Modelos Econométricos de Ecuaciones Simultáneas (JMW16)

Capítulo VI: MODELOS DE VARIABLE DEPENDIENTE LIMITADA

Tema 08: Modelos de Elección Discreta ? Estimación de Máxima Verosimilitud (SW11)

Tema 09: Modelos de Función de Densidad Truncada (JMW17 ? CSS7)

Tema 10: Modelos de Respuesta Múltiple (CSS6

TERCERA UNIDAD

Capítulo VII: Econometría de Series de Tiempo

Tema 11: Conceptos Fundamentales (GP21)

Tema 12: Enfoque de los Pronósticos Económicos

Capítulo VIII: MODELOS ECONOMÉTRICOS DINÁMICOS EN SERIES DE TIEMPO

Tema 13: Modelos Autorregresivos y Rezagos Distribuidos (GP17)

Capítulo IX: ESTIMACIÓN DE EFECTOS CAUSALES DINÁMICOS

Tema 14: Inferencia causal y contrafactuales (SLV3)

Tema 15: Modelos de Efectos Causales (SW15)

Capítulo X: TEMAS AVANZADOS DE SERIES TEMPORALES

Tema 16: Modelos Dinámicos Autorregresivos (SW16)

Tema 17: exposición de la Investigación Formativa y Proyección Social Universitaria

6. ESTRATEGIAS DE ENSEÑANZA APRENDIZAJE

6.1. Métodos

Método expositivo en las clases teóricas las que se desarrollarán virtualmente por la plataforma DUTIC, CANVAS o MEET GOOGLE

Método para la elaboración del proyecto de investigación formativa virtual

Método del trabajo independiente para la elaboración de los cuadros resumen de los contenidos de la asignatura.

6.2. Medios

Videos, software, laptop, Internet, plataformas educativas, herramientas Google, etc.

6.3. Formas de organización

i. Clases teóricas virtuales: En ellas, el profesor explicará en detalle todos los contenidos teóricos del curso y resolverá algún ejercicio básico de aplicación de esos contenidos teóricos. Se desarrollará de acuerdo al temario señalado en el presente silabo, en la mayoría de los casos se realizará mediante clases magistrales por parte del docente.

ii. Seminarios: Virtuales

iii. Prácticas virtuales: Resolución de problemas: Los alumnos deben haber trabajado con anterioridad los problemas a realizar en la clase virtual, y se espera que pueda presentar la solución a cualquiera de ellos en público. La última parte de la clase se dedicará a la resolución individual de uno de los ejercicios (elegido al azar) de la hoja de problemas correspondiente o de una variación de uno de los ejercicios previamente distribuidos.

iv. Laboratorio: Resolución de un ejercicio práctico con software econométrico (Stata 14, 16, Gretl). El profesor guiará la resolución del ejercicio correspondiente y en la última parte de la clase el estudiante resolverá una variante del ejercicio de forma virtual e individual.

6.4. Programación de actividades de investigación formativa y responsabilidad social

Elaboración de proyectos de aplicación por parte de los estudiantes, que permite desarrollar investigación formativa vinculada a la asignatura.

ii. Responsabilidad Social:

Asimismo, los proyectos de investigación preparados por los estudiantes están vinculados con la responsabilidad social, dado que éstos responden a necesidades actuales de la sociedad. De igual forma, con la aplicación de la ciencia econométrica permite a la Facultad de Economía formar ciudadanos

responsables con su entorno, generadores de ideas creativas y comprometidas para ayudar a solucionar problemas económicos, sociales y ambientales.

Estas tareas serán realizadas en forma conjunta con un grupo de docentes de la Facultad de Economía y se acordó desarrollar el siguiente trabajo de Investigación Formativa y de Responsabilidad Social Universitaria:

?Impacto del COVID-19 en las MYPES de la Provincia de Arequipa ? 2020?, para nuestro caso es el tema relacionado con el EMPLEO.

7. CRONOGRAMA ACADÉMICO

SEMANA	TEMA	DOCENTE	%	ACUM.
1	Análisis de Regresión Múltiple ? MCO asintóticos (SW17)	J. Rojas L.	5.88	5.88
2	Análisis de Regresión Múltiple: Inferencia (SW18)	J. Rojas L.	5.88	11.76
3	Análisis de la Regresión Múltiple: Métodos de pruebas de la Correlación Serial	J. Rojas L.	5.88	17.64
4	Métodos Simple para Datos Panel (JMW13)	J. Rojas L.	5.88	23.52
5	Regresión con datos Panel (SW10)	J. Rojas L.	5.88	29.40
6	Métodos avanzados para datos panel (JMW14)	J. Rojas L.	5.88	35.28
7	Modelos Econométricos de Ecuaciones Simultáneas (JMW16)	J. Rojas L.	5.88	41.16
8	Modelos de Elección Discreta ? Estimación de Máxima Verosimilitud (SW11)	J. Rojas L	5.88	47.04
9	Modelos de Función de Densidad Truncada (JMW17 ? CSS7)	J. Rojas L	5.88	52.92
10	Modelos de Respuesta Múltiple (CSS6	J. Rojas L	5.88	58.80
11	Conceptos Fundamentales (GP21)	J. Rojas L	5.88	64.68
12	Enfoque de los Pronósticos Económicos	J. Rojas L	5.88	70.56
13	Modelos Autorregresivos y Rezagos Distribuidos (GP17)	J. Rojas L	5.88	76.44
14	Inferencia causal y contrafactuales (SLV3)	J. Rojas L	5.88	82.32
15	Modelos de Efectos Causales (SW15)	J. Rojas L	5.88	88.20
16	Modelos Dinámicos Autorregresivos (SW16)	J. Rojas L	5.88	94.08
17	exposición de la Investigación Formativa y Proyección Social Universitaria	J. Rojas L	5.92	100.00

8. ESTRATEGIAS DE EVALUACIÓN

8.1. Evaluación del aprendizaje

Prácticas Presenciales, controles de lectura, participación en clase, investigación formativa, exposiciones

8.2. Cronograma de evaluación

EVALUACIÓN	FECHA DE EVALUACIÓN	EXAMEN TEORÍA	EVAL. CONTINUA	TOTAL (%)
Primera Evaluación Parcial	10-10-2022	13%	20%	**33%**
Segunda Evaluación Parcial	28-11-2022	13%	20%	**33%**
Tercera Evaluación Parcial	26-12-2022	14%	20%	**34%**
			TOTAL	**100%**

9. REQUISITOS DE APROBACIÓN DE LA ASIGNATURA

a) El estudiante tendrá derecho a observar o en su defecto a ratificar las notas consignadas en sus

evaluaciones, después de ser entregadas las mismas por parte del profesor, salvo el vencimiento de plazos para culminación del semestre académico, luego del mismo, no se admitirán reclamaciones,

estudiante que no se haga presente en el día establecido, perderá su derecho a reclamo.

b) Para aprobar la asignatura el estudiante debe obtener una nota igual o superior a 11 (Once); en el promedio final.
c) El redondeo, solo se efectuará en el cálculo del promedio final, quedado expreso, que las notas parciales, no se redondearan individualmente.
d) El estudiante que no tenga alguna de sus evaluaciones y no haya solicitado evaluación de rezagados en el plazo oportuno, se le considerará como abandono.
e) El estudiante quedará en situación de ?abandono? si el porcentaje de asistencia es menor al ochenta (80%) por ciento en las actividades que requieran evaluación continua.

10. BIBLIOGRAFÍA: AUTOR, TÍTULO, AÑO, EDITORIAL

10.1. Bibliografía básica obligatoria

? Stock, J. H., y Watson, M. M. (2012). Introducción a la econometría. (Tercera edición). Madrid, España: Pearson Educación, S. A.
? Wooldridge, J. M. (2012). Introducción a la econometría, Un enfoque moderno. (Cuarta edición). México, D.F., México: Cengage Learning Editores, S. A. de C. V.

10.2. Bibliografía de consulta

? Caridad, J. M. (2012). Modelos econométricos uniecuacionales. Barcelona, España: Editorial Reverté, S. A.
? Court, E., y Rengifo, E. (2011). Estadísticas y econometría financiera. (Primera edición). Buenos Aires, Argentina: Cengage Learning Argentina
? Greene, W. H. (2003). Econometric analysis. (Fifth edition). New Jersey, United States: Pearson Education, Inc.
? Gujarati, D. N., y Porter, D. C. (2010). Econometría. (Quinta edición). México, D. F., México: McGraw-Hill/Interamericana Editores, S. A. de C. V.
? Gujarati, D. N. (2006). Principios de econometría. (Tercera edición). Madrid, España: McGraw-Hill/Interamericana de España, S. A. U.
? Pindyck, R. S., y Rubinfeld, D. L. (2001). Econometría: Modelos y pronósticos. (Cuarta edición). México. D.F., México: McGraw-Hill/Interamericana Editores, S. A. de C. V.

Arequipa, 18 de Octubre del 2022

CHOQUE LUZA, FERNANDO **PERALTA CALCINA, JONNE**

ROJAS LOPEZ, JOSE