



Casa abierta al tiempo

UNIVERSIDAD AUTONOMA METROPOLITANA

DSE-11 5M0798

PROGRAMA DE ESTUDIOS

1 / 3

UNIDAD AZC-IZT-XOC		DIVISION CIENCIAS SOCIALES Y HUMANIDADES	
NIVEL MAESTRIA		EN CIENCIAS ECONOMICAS	
CLAVE 920711	UNIDAD ENSEÑANZA-APRENDIZAJE ECONOMETRIA		TRIM. IV
HORAS TEORIA 4.0	SERIACION POR AUTORIZACION		CREDITOS 10
HORAS PRACTICA 2.0			OPT./OBL. OBL.

OBJETIVO (S) :

GENERALES: El alumno deberá ser capaz de:

Manejar las técnicas de la econometría estableciendo modelos y dando el diagnostico de su propio diseño.

PARTICULARES:

1. Utilizar la teoría de la regresión múltiple.
2. Analizar y determinar un curso de acción cuando no se cumplan los supuestos formales de la teoría.
3. Analizar los casos donde se requiera un modelo de ecuaciones simultáneas o uniecuacional.
4. Establecer la existencia o no de series con tendencia.

CONTENIDO SINTETICO:

1. El modelo de regresión lineal.
  - 1.1 Mínimos cuadrados; 1.2 teorema de Gauss-Markov; 1.3 prueba F.
2. Rompimiento de los supuestos del modelo básico.
  - 2.1 Error de especificación; 2.2 multicolinealidad; 2.3 normalidad.
3. Heterocedasticidad.
  - 3.1 Breusch-Pagan; 3.2 modelos ARCH, GARCH.
4. Autocorrelación.
  - 4.1 Durbin-Watson; 4.2 prueba de Ljung-Box; 4.3 regresión espúrea.
5. Ecuaciones simultáneas.
  - 5.1 Forma estructural y reducida; 5.2 identificación del modelo; 5.3 métodos de estimación.
6. Raíces unitarias, cointegración, modelos de corrección de errores.
7. Modelos no-lineales, principios de LR, Wald y LM.

Edmundo Jaco H.



Casa abierta al tiempo

**UNIVERSIDAD AUTONOMA METROPOLITANA**

**ADECUACION  
PRESENTADA AL COLEGIO ACADEMICO  
EN SU SESION NUM. 226**

**EL SECRETARIO DEL COLEGIO**

SELLO



Casa abierta al tiempo

UNIVERSIDAD AUTONOMA METROPOLITANA

UNIDAD AZC-IZT-XOC		DIVISION CIENCIAS SOCIALES Y HUMANIDADES	
NIVEL MAESTRIA		EN CIENCIAS ECONOMICAS	
CLAVE 920711	UNIDAD ENSEÑANZA-APRENDIZAJE ECONOMETRIA		TRIM. IV
HORAS TEORIA 4.0	SERIACION POR AUTORIZACION		CREDITOS 10
HORAS PRACTICA 2.0			OPT/OBL. OBL.

MODALIDADES DE CONDUCCION DEL PROCESO DE ENSEÑANZA-APRENDIZAJE:

- Presentación de los temas del curso en el salón de clases.
- Realización de ejercicios durante la clase.
- Elaboración de tareas para hacer en casa.
- Exposiciones y/o ensayos por parte de los alumnos, por cada tema.

MODALIDADES DE EVALUACION:

Evaluación periódica y terminal a través de:  
 Talleres y prácticas.  
 Exámenes y trabajos.  
 Laboratorio de observación y desarrollo de habilidades.

BIBLIOGRAFIA NECESARIA O RECOMENDABLE:

Greene William, "Econometric analysis", Ed. MacMillan, New York, 1993.

Maddala G.S., "Introducción a la econometría", Ed, Prentice Hall, México, 1996.

Judge G. et. al., "The theory and practice of econometrics", Ed. John Wiley, and Sons, USA, 1980.

Spanos A., "Statistical foundations of econometric modeling", Cambridge Univ. Press, Cambridge, U.K., 1986.

Harvey A.C., "The econometric analysis of time series", Ed. Philip Allan, Oxford, 1981.

Edmundo Jacobo H.



UNIVERSIDAD AUTONOMA METROPOLITANA

ADECUACION  
PRESENTADA AL COLEGIO ACADEMICO  
EN SU SESION NUM. 226

EL SECRETARIO DEL COLEGIO

SELLO



Casa abierta al tiempo

UNIVERSIDAD AUTONOMA METROPOLITANA

DSE-11 5M0798

PROGRAMA DE ESTUDIOS

3 / 3

UNIDAD AZC-IZT-XOC		DIVISION CIENCIAS SOCIALES Y HUMANIDADES	
NIVEL MAESTRIA		EN CIENCIAS ECONOMICAS	
CLAVE 920711	UNIDAD ENSEÑANZA-APRENDIZAJE ECONOMETRIA		TRIM. IV
HORAS TEORIA 4.0	SERIACION POR AUTORIZACION		CREDITOS 10
HORAS PRACTICA 2.0			OPT/OBL. OBL.

Hendry D. Morgan D., The foundations of econometric analysis,  
Cambridge, University Press, Cambridge, USA., 1995.

Edmundo Jacobo H.



Casa abierta al tiempo

UNIVERSIDAD AUTONOMA METROPOLITANA

ADECUACION  
PRESENTADA AL COLEGIO ACADÉMICO  
EN SU SESION NUM. 226

EL SECRETARIO DEL COLEGIO

SELLO