

UNIDAD AZCAPOTZALCO		DIVISION CIENCIAS SOCIALES Y HUMANIDADES		1/ 3
NOMBRE DEL PLAN MAESTRIA EN ECONOMIA (HISTORIA ECONOMICA; EMPRESAS, FINANZAS E INNOVACION)				
CLAVE	UNIDAD DE ENSEÑANZA-APRENDIZAJE ECONOMETRIA	CREDITOS	10	
1236078		TIPO	OBL.	
H.TEOR. 4.0		TRIM.	IV	
H.PRAC. 2.0	SERIACION 1236115 Y AUTORIZACION	NIVEL	MAESTRIA	

OBJETIVO(S):

General:

Al final de la UEA el alumno será capaz de:

Modelar y predecir con modelos econométricos multivariados y univariados.

Específicos:

Al final de la UEA el alumno será capaz de:

- Especificar y estimar modelos econométricos cuando no se cumplen los supuestos del modelo de regresión clásico.
- Diseñar y estimar modelos econométricos de variables dependientes cualitativas.
- Especificar y estimar modelos de series de tiempo.

CONTENIDO SINTETICO:

1. Introducción al modelaje econométrico.
 - 1.1. Conceptos, definiciones y metodología econométrica.
 - 1.2. Modelo de regresión múltiple: supuestos y estimación.
 - 1.3. Pruebas de diagnóstico: normalidad, multicolinealidad, heterocedasticidad y autocorrelación.



UNIVERSIDAD AUTÓNOMA METROPOLITANA

ADECUACION
PRESENTADA AL COLEGIO ACADEMICO
EN SU SESION NUM. 458

EL SECRETARIO DEL COLEGIO

NOMBRE DEL PLAN MAESTRIA EN ECONOMIA (HISTORIA ECONOMICA; EMPRESAS, FINANZAS E INNOVACION)		2/ 3
CLAVE 1236078	ECONOMETRIA	

2. Modelaje con datos de corte transversal.
 - 2.1. Regresión y causalidad.
 - 2.2. Problema de endogeneidad.
 - 2.3. Modelos de variables instrumentales.
 - 2.4. Estimación por Mínimos Cuadrados Bietápicos (MC2E).
 - 2.5. Modelos de ecuaciones simultáneas.
 - 2.6. Método de Máxima Verosimilitud (MV).
 - 2.7. Modelos con variables dependientes discretas.
 - 2.7.1. Variables dicotómicas: MPL, LOGIT, PROBIT.
 - 2.7.2. Modelos ordenados y multinomiales.
 - 2.7.3. Modelos de variables censuradas: Tobit tipo I y II (autoselección).
3. Modelos de series de tiempo.
 - 3.1. Introducción.
 - 3.2. Elementos estadísticos en el análisis de series de tiempo.
 - 3.3. Series de tiempo vistas como procesos estocásticos.
 - 3.4. Procesos estacionarios.
 - 3.5. Modelos autorregresivos (AR).
 - 3.6. Modelos de promedios móviles (MA).
 - 3.7. Modelos ARMA.
 - 3.8. Funciones de autocorrelación.
 - 3.9. Raíces unitarias.
 - 3.10. Caminatas aleatorias.

MODALIDADES DE CONDUCCION DEL PROCESO ENSEÑANZA-APRENDIZAJE:

El profesor realizará la exposición de los temas y dirigirá a los alumnos en la realización de ejercicios tanto de aplicación matemática como de comprensión de lectura y comunicación escrita.

MODALIDADES DE EVALUACION:

Trabajos escritos, ejercicios y evaluaciones escritas. El peso específico de cada modalidad será establecido por el profesor, la que deberá ser de cuando menos 20% de la calificación.



Casa abierta al tiempo

UNIVERSIDAD AUTONOMA METROPOLITANA

ADECUACION
PRESENTADA AL COLEGIO ACADEMICO
EN SU SESION NUM. 458

EL SECRETARIO DEL COLEGIO

NOMBRE DEL PLAN	MAESTRIA EN ECONOMIA (HISTORIA ECONOMICA; EMPRESAS, FINANZAS E INNOVACION)	3 / 3
CLAVE	1236078	ECONOMETRIA

BIBLIOGRAFIA NECESARIA O RECOMENDABLE:

- Angrist J. y J. Pischke (2009). Mostly harmless econometrics. An empiricist's companion, Princeton University Press.
- Cameron C. y K. Trivedi (2005). Microeconometrics. Methods and applications, Cambridge University Press.
- Davidson, R. y J. MacKinnon (2004). Econometric theory and methods, Oxford.
- Enders, W. (2005). Applied econometric time series, John Wiley & Sons.
- Greene, W. (1999). Análisis econométrico, 3a Ed., Prentice Hall.
- Griffiths, W., Hill, R. y G. Judge (1993). Learning and practicing econometrics, John Wiley & Sons.
- Guerrero, V. (2003). Análisis estadístico de las series de tiempo económicas, 2da. Ed., Thomson.
- Kennedy, P. (2004). Guide to Econometrics, Blackwell Publishers.
- Shumway R. y Stoffer D. (2006). Time series analysis and its applications, Springer.
- Wooldrige, J. (2001). Introducción a la econometría. Un enfoque moderno, 6ta. Ed., México: Thomson Learning.
- Wooldrige, J. (2007). Econometric analysis of cross section and panel data, 2da edit., the MIT press.



UNIVERSIDAD AUTONOMA METROPOLITANA

ADECUACION
PRESENTADA AL COLEGIO ACADEMICO
EN SU SESION NUM. 458

EL SECRETARIO DEL COLEGIO