

**UNIVERSIDAD NACIONAL
FACULTAD DE CIENCIAS SOCIALES
ESCUELA DE ECONOMÍA**

CARRERA:	Bachillerato y Licenciatura en Economía
CÓDIGO DE LA CARRERA:	050709 (Bachillerato) y 050708 (Licenciatura)
NOMBRE DEL CURSO:	Econometría II
TIPO DE CURSO:	Regular
CÓDIGO DE CURSO:	ECB418
NIVEL:	III
PERIODO LECTIVO:	II Ciclo 2018
MODALIDAD:	17 SEMANAS
NATURALEZA:	TEÓRICO PRÁCTICO
CRÉDITOS:	4
HORAS SEMANALES:	11
HORARIO DE ATENCIÓN:	1 Se realizará una hora antes/después del inicio de clases, con arreglo a las indicaciones del profesor en la primera clase del curso.
HORAS PRESENCIALES:	4
HORAS DE ESTUDIO INDEPENDIENTE:	7
REQUISITOS:	ECB413 Econometría I
DOCENTE:	Grupo 01 Miércoles 8:00 – 11: 20, Aula 227 Profesor David Cardoza Rodríguez (david.cardoza.rodriguez@una.cr) Grupo 02 Miércoles 18:00 – 21:20, Aula 229 Profesor Mariano Segura Ávila (mariano.segura@presidencia.go.cr)
CÁTEDRA	Métodos Cuantitativos, coordinada por el Profesor David Cardoza

I. DESCRIPCIÓN DEL CURSO

El curso de Econometría II profundiza en el análisis iniciado en Econometría I proporcionando una introducción de los modelos econométricos de mayor utilización adaptados a estructuras de datos concretas.

El curso está organizado para un semestre donde se estudiarán dos grandes tópicos de la econometría. El primer tópico análisis de series de tiempo, haciéndose énfasis en el pronóstico. En la segunda parte del curso se introduce a diferentes técnicas en el campo de la micro-econometría como variables instrumentales, regresión logística y técnica de datos de panel.

II. OBJETIVO GENERAL

Profundizar en los conocimientos teóricos y prácticos adquiridos de Econometría I, las limitaciones del modelo de regresión lineal básica, la ampliación de modelos no lineales, de manera que permita la comprensión de técnicas econométricas avanzadas en el campo de la economía aplicada. Al concluir el curso el estudiante podrá identificar y aplicar los modelos a situaciones específicas del campo de la macroeconometría y microeconometría.

III. OBJETIVOS ESPECÍFICOS

- Al finalizar el curso el estudiante debe comprender la base teórica de la econometría moderna.
- Analizar los modelos de series de tiempo de uso práctico en la macroeconomía.
- Comprensión del uso de modelos econométricos aplicados a la microeconomía como datos de panel y modelos de elección discreta.

IV. APRENDIZAJES INTEGRALES

Con arreglo al perfil profesional establecido en el Plan de estudios del Bachillerato y Licenciatura en Economía, el graduado de la Escuela de Economía poseerá los siguientes saberes:

Saber conceptual

- Modelos univariantes de series de tiempo.
- Cointegración y corrección de errores
- Modelos de rezagos distribuidos
- Modelos no lineales
- Vectores Autorregresivos
- Modelos binarios
- Datos de Panel

Saber procedimental (Habilidades y destrezas)

- Aplicar el análisis económico para evaluar los problemas cotidianos.
- Aplicar el análisis económico para evaluar propuestas políticas específicas.
- Comprender el papel de los supuestos en los argumentos.
- Presentar, tabular y graficar la información estadística.
- Entender cómo usar evidencia empírica para evaluar un argumento económico.
- Interpretar los resultados estadísticos.
- Realizar un análisis estadístico adecuado de los datos y explicar los problemas estadísticos involucrados.
- Conoce el funcionamiento de las bases de datos de información cuantitativas y bibliográficas
- Saber cómo localizar y utilizar fuentes de datos primarias (INEC, BCCR, Contabilidad Nacional, otros)
- Utilizar paquetes informáticos para uso general y especializado para economistas

Saber actitudinal (Actitudes y valores)

Los valores y actitudes que la Escuela busca inculcar a través de sus planes de estudio tienen carácter transversal, pues todos los cursos se comprometen con ellos. Estos son: la búsqueda de la verdad, la excelencia, la equidad y la igualdad de oportunidades y la honestidad intelectual.

V. APROXIMACION PEDAGOGICA Y SISTEMA DE EVALUACION

El curso tiene una orientación teórico - práctica. Se impartirán clases magistrales y además se asignarán ejercicios y trabajos que faciliten la comprensión de los diversos temas que se abordarán en el curso.

Es obligatoria la revisión previa del material asignado para cada clase. Al final del curso el estudiante debe presentar un documento de investigación donde aplique los tópicos estudiados en el curso.

La evaluación se realizará mediante exámenes teóricos-prácticos, coordinados por la Cátedra de Estadística y Econometría. El estudiantado será calificado con base en una escala que va de cero a diez. Las evaluaciones se efectuarán en las horas lectivas correspondientes al curso y en las fechas previamente establecidas en el programa. Si se requiere una modificación en el horario y en las fechas previstas, debe existir acuerdo entre docentes y estudiantes en la nueva fecha designada.

La calificación mínima de aprobación es siete y el curso evaluará de la siguiente manera:

Mecanismo	Porcentaje
Primer examen parcial	30%
Segundo examen parcial	30%
Examen final	25%
Trabajo de Investigación	15%
Total	100%

Es de suma importancia la asistencia a clase del curso y el estudiante que tenga tres ausencias injustificadas perderá el curso. No se repondrán exámenes salvo las excepciones dispuestas por el reglamento académico de la Universidad Nacional y previa presentación de la justificación correspondiente. Las prácticas y tareas se recibirán únicamente en las fechas designadas por el profesor (SIN NINGUNA EXCEPCIÓN). La atención de los estudiantes se realizará antes de clases o días a convenir, previa cita con el profesor.

Adecuación: En los casos de los estudiantes con necesidades especiales, previa comunicación oficial por parte de las autoridades o el estudiante, el profesor elaborará un plan de trabajo en la segunda semana del curso, el cual será remitido a la Subdirección para su incorporación al expediente.

Sobre las ausencias: de acuerdo con las facultades establecidas en el Reglamento General sobre los Procesos de Enseñanza y Aprendizaje de la UNA, y dadas las características del curso con conocimientos acumulativos, de carácter teórico práctico y alto grado de dificultad, con tres (3) ausencias injustificadas se pierde el curso.

VI. TEMARIO

Tema 1: Modelos Univariantes de Series de Tiempo

OBJETIVO: Introducir al análisis de series de tiempo aplicado a la economía.

- Suavizamiento y extrapolación de series de tiempo
- Método de Holt, Holt-Winters
- Modelos lineales de series de tiempo. MA, AR, ARIMA, SARIMA.
- Descomposición de las series de tiempo
- Modelos no lineales de series de tiempo: ARCH y GARCH.

Capítulo 21 y 22 (G), Cap. 8, 15 16, 17 y 18 (P-R), Cap. 2,3,4,5,6,7,8 y 9 (P), (H) Cap. 7, Cap. 14 (S-W)

Tema 2: Cointegración y Corrección de Errores

OBJETIVO: Analizar la relación de corto y largo plazo entre series económicas.

- Pruebas de Raíz Unitaria
- Pruebas para la cointegración
- Corrección de errores
- Estimación de ecuaciones de corto plazo
- Vectores Autorregresivos

Capítulo 21 y 22 (G-P), Cap., Cap. 13, 17 (P-R), Cap. 5 y 6 (Ch-D), (H) Cap. 8, Cap. 16 (S-W)

Tema 3: Modelos de Rezagos Distribuidos

OBJETIVO: Modelar la dinámica de series económicas.

- Teoría Asintótica
- Estimación de modelos con rezagos distribuidos
- Método de Koyck para los modelos de rezagos distribuidos
- Método de Almon para los modelos de rezagos distribuidos

Capítulos: 17 (G-P), Cap. 11 (P-R) Cap. 18 (J-W)

Tema IV: Modelos de elección binaria

OBJETIVO: Introducir a la modelística de variables cualitativas aplicadas al campo de la microeconometría.

- Variables indicadoras para cambios en intercepto
- Variables indicadoras para cambios en los coeficientes de pendiente
- Modelos Logit y Probit.

Capítulos: 15 (G-P), Cap. 11 (P-R), Cap. 7 y 17 (J-W), Cap. 11 (S-W)

Tema V: Modelos de ecuaciones simultáneas

OBJETIVO: Estimar modelos macroeconómicos.

- El problema de identificación.
- MC2E y MC3E.
- El método de variables instrumentales.
- Test de Especificación de Hausman.

Capítulos: 18, 19 y 20 (G), Cap. 7 y 12 (P-R), Cap. 15 (J-W), Cap. 12 (S-W)

Tema VI: Introducción a los modelos de Datos de Panel

OBJETIVO: Introducir a técnicas de regresión de modelos de datos de panel estáticos y dinámicos.

- La combinación de datos de serie temporal y datos de corte transversal.
- Especificación del modelo de errores compuestos: efectos fijos y efectos aleatorios.
- Modelos de datos de panel dinámicos.

Capítulos: 16 (G) 13 y 14 (J-W).

VII. CRONOGRAMA

Semana	Fecha	Tema
1	23 julio (25 de julio feriado)	Modelos de Series de Tiempo
2	30 Julio	ARIMA
3	06 agosto	ARIMA-SARIMA
4	13 agosto	ARCH
5	20 agosto	VAR-VEC
6	27 agosto	VAR-VEC
7	03 setiembre	Parcial I
8	10 setiembre	Modelos de Rezagos Distribuidos
9	17 setiembre	Modelos de elección Binaria
10	24 setiembre	Modelos de elección Binaria
11	01-octubre	Ecuaciones Simultáneas
12	08-octubre	Ecuaciones Simultáneas
13	15-octubre	Parcial II
14	22-octubre	Datos de Panel
15	29-octubre	Panel Dinámicos
16	05-noviembre	Aplicaciones econométricas
17	12-noviembre	Examen final (Todos los temas)
18	19-noviembre	Entrega de notas/Semana de estudio para exámenes extraordinarios
19	26-noviembre	Examen extraordinario

VIII. BIBLIOGRAFÍA

- (A-P) Angrist, J.D. and Pischke J-S., (2009) Mostly Harmless Econometrics: An Empiricists Companion. Princeton University Press., USA.
- (Ch-D): Charemza, Wojcieh W. and Deadman, Derek F.(1997). Econometric Practice: General to Specific Modelling, Cointegration and Vector Autoregresion. Second Edition. Ewdard Elgar Publishing, Great Britain.
- (F) Fernández, Alonso (2005). Econometría. Primera edición. Prentice Hall, USA.
- (G-P): Gujarati, Damodar N y Porter, Dawn C. (2010). Econometría. Quinta edición. McGraw Hill Interamericana Editores, S. A. México D.F., México.
- (Gr):Greene, William H. (1997). Econometric Analysis Third edition. Prentice Hall, U.S.A.
- (H): Harvey, A C. (1999). The Econometric Analysis of Time Series. Cabridge, Massachusetts.
- (J-D): Johnston and Dinardo. (1997). "Econometric Methods". Editorial McGraw Hill. Singapore.

- (K): Kennedy, Peter (1981). A Guide to Econometrics. The MIT Press. Cambridge, Massachussets, U.S.A.
- (P-R): Pindyck, Robert S. y Rubinfeld, L. Daniel (2000). Econometría Modelos y Pronósticos. Cuarta Edición, Editorial McGraw Hill. México D. F., México.
- (P): Pankratz, A (1983). Forecasting with Univariate Box-Jenkins Models: Concepts and cases. JOHN WILEY & SONS, INC.
- (S-W) Stock, James H. and Watson, Mark M. (2012). Introducción a la Econometría. Pearson Educación S.A. Madrid, España.
- (J-W): Wooldridge, Jeffrey M. (2010). Introducción a la econometría moderna: Un enfoque moderno. Cuarta edición. Thomson Learning. U.S.A.
- (J-W): Wooldridge, Jeffrey M. (2002). Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data. IMT, U.S.A.

