



## FACULTAD DE CIENCIAS DE LA ADMINISTRACIÓN

### ESCUELA DE ECONOMÍA EMPRESARIAL

#### 1. Datos generales

**Materia:** ECONOMETRÍA II

**Código:** FAD0108

**Paralelo:**

**Periodo :** Marzo-2017 a Julio-2017

**Profesor:** FREIRE CRUZ MANUEL R

**Correo electrónico:** mafreire@uazuay.edu.ec

#### Prerrequisitos:

Código: FAD0100 Materia: ECONOMETRÍA I

| Docencia | Práctico | Autónomo:            |          | Total horas |
|----------|----------|----------------------|----------|-------------|
|          |          | Sistemas de tutorías | Autónomo |             |
| 4        |          |                      |          | 4           |

#### 2. Descripción y objetivos de la materia

La econometría se ha concebido dentro de la Escuela de Economía como un instrumento de análisis cuantitativo que sirva en lo fundamental para la toma de decisiones, a partir de la construcción empírica de modelos econométricos de la microeconomía y de la macroeconomía. De esta apreciación inicial se desprende la importancia que tiene la econometría en formulación de modelos explicativos aplicados en la gestión pública y privada, en los ámbitos nacional, regional, local o empresarial.

Analizar e interpretar las cifras estadísticas de política fiscal de la economía ecuatoriana, regional, local o empresarial. Distinguir los elementos críticos del mercado y de la empresa

Las Econometría I y II constituyen una herramienta de fundamental uso en la carrera de Economía por cuanto permite, a partir de la construcción de modelos econométricos, la interpretación de variables que confluyen simultáneamente, en forma individual y conjunta, en el análisis de temas de la teoría económica y otros afines. Particularmente puede asociarse a: Macroeconomía, Microeconomía, Finanzas, Estrategia Empresarial, Análisis de la Economía Ecuatoriana, Política Económica.

#### 3. Contenidos

|      |                                                                                                            |
|------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.   | <b>General 1 : Revisión de Econometría I</b>                                                               |
| 1.1. | Revisión: Repaso de contenidos I (2 horas)                                                                 |
| 1.2. | Revisión: Repaso de contenidos II (2 horas)                                                                |
| 2.   | <b>General: Análisis Econométrico con Eviews</b>                                                           |
| 2.1  | Análisis Econométrico con Eviews (Introducción) (2 horas)                                                  |
| 2.2  | La Lógica de trabajo en el Eviews: los objetos (1 horas)                                                   |
| 2.3  | Introducción de datos con Eviews (1 horas)                                                                 |
| 2.4  | Especificación y estimación de un MRCL con Eviews (2 horas)                                                |
| 2.5  | Mínimos Cuadrados Ordinarios con Eviews (2 horas)                                                          |
| 2.6  | Construir y evaluar los modelos en ejecución con Eviews (6 horas)                                          |
| 3    | <b>General 2: Multicolinealidad, Heterocedasticidad y Autocorrelación</b>                                  |
| 3.1  | Multicolinealidad exacta y aproximada: causas, problemas, detección y soluciones (4 horas)                 |
| 3.2  | Heterocedasticidad: causas, problemas, detección y soluciones (4 horas)                                    |
| 3.3  | <b>Autocorrelación: causas, problemas, detección y soluciones</b>                                          |
| 3.4  | Construcción de modelos aplicados con los conocimientos adquiridos en Econometría I y el Eviews. (6 horas) |
| 4    | <b>General: Regresión con variable dependiente dicotómica: El modelo Logit</b>                             |
| 4.1  | El modelo Logit (4 horas)                                                                                  |
| 4.2  | Estimación del modelo Logit (4 horas)                                                                      |
| 4.3  | Ejercicios de aplicación del modelo Logit (6 horas)                                                        |
| 5    | <b>General: Series temporales no estacionarias</b>                                                         |

|     |                                          |
|-----|------------------------------------------|
| 5.1 | Test de estacionaridad (4 horas)         |
| 5.2 | Series temporales cointegradas (4 horas) |
| 5.3 | Ejemplos de aplicación (6 horas)         |
| 5.4 | Ejemplos de aplicación (0 horas)         |
| 5.5 | Ejemplos de aplicación (0 horas)         |
| 5.6 | Ejemplos de aplicación (0 horas)         |

#### 4. Sistema de Evaluación

Resultado de aprendizaje de la carrera relacionados con la materia

| Resultado de aprendizaje de la materia                                                                                      | Evidencias                                                                                 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>ar. Aplicar las herramientas cuantitativas para medir e interpretar los indicadores macroeconómicos de una Economía.</b> | -Construcción de modelos de econométricos: conceptualización, estimación e interpretación. |
| <b>bd. Demostrar la utilización de conocimientos científicos básicos y de herramientas tecnológicas especializadas.</b>     | -Trabajos prácticos - productos                                                            |
|                                                                                                                             | -Análisis, validación y utilización de los modelos.                                        |
|                                                                                                                             | -Evaluación escrita                                                                        |

#### Desglose de evaluación

| Evidencia                      | Descripción     | Contenidos sílabo a evaluar                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | Aporte     | Calificación | Semana                                   |
|--------------------------------|-----------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|--------------|------------------------------------------|
| Trabajos prácticos - productos | Capítulos 1,2   | General 1 : Revisión de Econometría I, General: Análisis Econométrico con Eviews                                                                                                                                                                                                                                                       | APORTE 1   | 4            | Semana: 5 (17/04/17 al 22/04/17)         |
| Evaluación escrita             | Capítulos 1,2   | General 1 : Revisión de Econometría I, General: Análisis Econométrico con Eviews                                                                                                                                                                                                                                                       | APORTE 1   | 6            | Semana: 5 (17/04/17 al 22/04/17)         |
| Trabajos prácticos - productos | Capítulos 3,4   | Autocorrelación: causas, problemas, detección y soluciones, General 2: Multicolinealidad, Heterocedasticidad y Autocorrelación, General: Regresión con variable dependiente dicotómica: El modelo Logit                                                                                                                                | APORTE 2   | 5            | Semana: 10 (22/05/17 al 27/05/17)        |
| Evaluación escrita             | Capítulos 3,4   | Autocorrelación: causas, problemas, detección y soluciones, General 2: Multicolinealidad, Heterocedasticidad y Autocorrelación, General: Regresión con variable dependiente dicotómica: El modelo Logit                                                                                                                                | APORTE 2   | 5            | Semana: 10 (22/05/17 al 27/05/17)        |
| Trabajos prácticos - productos | Capítulos 4,5   | General: Regresión con variable dependiente dicotómica: El modelo Logit, General: Series temporales no estacionarias                                                                                                                                                                                                                   | APORTE 3   | 5            | Semana: 15 (26/06/17 al 01/07/17)        |
| Evaluación escrita             | Capítulos 4,5   | General: Regresión con variable dependiente dicotómica: El modelo Logit, General: Series temporales no estacionarias                                                                                                                                                                                                                   | APORTE 3   | 5            | Semana: 15 (26/06/17 al 01/07/17)        |
| Evaluación escrita             | Capítulos 1 a 5 | Autocorrelación: causas, problemas, detección y soluciones, General 1 : Revisión de Econometría I, General 2: Multicolinealidad, Heterocedasticidad y Autocorrelación, General: Análisis Econométrico con Eviews, General: Regresión con variable dependiente dicotómica: El modelo Logit, General: Series temporales no estacionarias | EXAMEN     | 20           | Semana: 17-18 (09-07-2017 al 22-07-2017) |
| Evaluación escrita             | Capítulos 1 a 5 | Autocorrelación: causas, problemas, detección y soluciones, General 1 : Revisión de Econometría I, General 2:                                                                                                                                                                                                                          | SUPLETORIO | 20           | Semana: 19-20 (23-07-2017 al 29-07-2017) |

| Evidencia | Descripción | Contenidos sílabo a evaluar                                                                                                                                                                                              | Aporte | Calificación | Semana |
|-----------|-------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|--------------|--------|
|           |             | Multicolinealidad, Heterocedasticidad y Autocorrelación, General: Análisis Econométrico con Eviews, General: Regresión con variable dependiente dicotómica: El modelo Logit, General: Series temporales no estacionarias |        |              |        |

## Metodología

La metodología comprende:

1. Clase magistral / Evaluación o resolución de casos
2. Trabajo / Investigación individual o colectivo

## Criterios de Evaluación

1. Presentación de las evaluaciones y trabajos en materiales apropiados
2. Redacción y ortografía adecuados
3. Comprensión correcta de los fundamentos teóricos
4. Desarrollo correcto de los procedimientos solicitados

## 5. Referencias

### Bibliografía base

#### Libros

| Autor                        | Editorial     | Título                           | Año  | ISBN |
|------------------------------|---------------|----------------------------------|------|------|
| Salvatore D-Reagle D         | Mc. Graw Hill | Estadística y Econometría        | 2004 |      |
| Martín-Labeaga-Mochón        | PRENTICE HALL | Introducción a la Econometría    | 1997 |      |
| Carrascal-Gonzalez-Rodriguez | Alfaomega     | Análisis Econométrico con EViews | 2001 |      |
| Damodar Gujarati             |               | Econometría                      |      |      |
| Damodar Gujarati             |               | Econometría                      |      |      |
| Gujarati Damodar N           | Mc. Graw Hill | Principios de Econometría        | 2006 |      |

#### Web

#### Software

### Bibliografía de apoyo

#### Libros

#### Web

| Autor           | Título                                                                                                                       | URL                                                                                                             |
|-----------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Zax, Jeffrey    | Introductory Econometrics : Intuition, Proof, and Practice                                                                   | <a href="http://site.ebrary.com/lib/uazuay/detail.action?">http://site.ebrary.com/lib/uazuay/detail.action?</a> |
| Westhoff, Frank | Student Solutions Manual to Accompany an Introduction to Econometrics: a Self-Contained Approach : A Self-Contained Approach | <a href="http://site.ebrary.com/lib/uazuay/detail.action?">http://site.ebrary.com/lib/uazuay/detail.action?</a> |

#### Software

| Autor  | Título                   | URL | Versión |
|--------|--------------------------|-----|---------|
| OFFICE | Excel, Word, Power point |     | 2010    |

Docente

Director/Junta

Fecha aprobación: **13/03/2017**

Estado: **Aprobado**