



FACULTAD DE CIENCIAS DE LA ADMINISTRACIÓN ESCUELA DE ECONOMÍA

1. Datos generales

Materia: ECONOMETRÍA III

Código: ECN0019

Paralelo:

Periodo : Marzo-2022 a Agosto-2022

Profesor: FREIRE PESANTEZ ANDREA ISABEL

Correo electrónico afreire@uazuay.edu.ec

Prerrequisitos:

Código: ECN0014 Materia: ECONOMETRÍA II

Docencia	Práctico	Autónomo: 96		Total horas
		Sistemas de tutorías	Autónomo	
64			96	160

2. Descripción y objetivos de la materia

Particularmente puede asociarse a: Macroeconomía, Microeconomía, Finanzas, Crecimiento Económico, Análisis de la Economía Ecuatoriana, Política Económica.

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 verificación empírica de modelos de aplicación de la microeconomía y de la macroeconomía. De esta apreciación inicial se desprende la importancia que tiene la econometría en formulación de modelos explicativos en la gestión pública y privada.

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, II y III 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.

3. Contenidos

1	MODELOS DE REGRESIÓN NO LINEALES
1.1	Estrategia para la modelización de funciones no lineales (2 horas)
1.2	Funciones no lineales de una sola variable independiente (2 horas)
1.3	Interacciones entre variables independientes (2 horas)
2	REGRESIÓN CON VARIABLE DEPENDIENTE DICOTÓMICA: LOGIT Y PROBIT
2.1	Modelo lineal de probabilidad (1 horas)
2.2	Modelo Logit: Estimación y ejercicios (4 horas)
2.3	Modelo Probit: estimación y ejercicios (5 horas)
3	INTRODUCCIÓN A LA REGRESIÓN DE SERIES TEMPORALES
3.1	Conceptos fundamentales (1 horas)
3.2	Procesos estocásticos estacionarios y no estacionarios (2 horas)
3.3	Proceso estocástico de raíz unitaria (2 horas)
3.4	Proceso estocásticos estacionarios en tendencia y en diferencias (2 horas)
3.5	procesos estocásticos integrados (1 horas)
3.6	Regresiones espurias (1 horas)
3.7	Pruebas de estacionariedad (1 horas)
3.8	Pruebas de Raíz unitaria (1 horas)
3.9	Cointegración y pruebas de cointegración (2 horas)
3.10	Mecanismo de corrección de errores (1 horas)
4	ECONOMETRIA DE SERIES DE TIEMPO Y PRONÓSTICOS

4.1	Diferentes enfoques de Pronósticos económicos (1 horas)
4.2	Modelos Arma: Procesos autoregresivo y de medias móviles (2 horas)
4.3	Modelos Autoregresivos integrado de Medias móviles (2 horas)
4.4	Metodología Box-Jenkins: Identificación, estimación, examen de diagnóstico y pronóstico (2 horas)
4.5	Modelos de Vectores autoregresivos (VAR) (2 horas)
4.6	Estimación de un modelo VAR (3 horas)
4.7	Cuántas variables deben incluirse en un VAR y determinación de longitud de retardos (2 horas)
4.8	VAR y causalidad (1 horas)
4.9	Pronóstico con el modelo VAR (2 horas)
5.	VOLATILIDAD EN SERIES DE TIEMPO FINANCIERAS
5.1	Modelos Arch: Identificación, estimación y pronóstico (4 horas)
5.2	Modelos Garch: Identificación, Estimación y pronóstico (4 horas)
6	REGRESIÓN CON DATOS DE PANEL
6.1	¿Por qué datos Panel? Ejemplos de datos panel balanceado y desbalanceado (1 horas)
6.2	Panel Balanceado y desbalanceado, Corto y largo (2 horas)
6.3	Modelo de efectos fijos (3 horas)
6.4	Modelo de efectos aleatorios (3 horas)

4. Sistema de Evaluación

Resultado de aprendizaje de la carrera relacionados con la materia

Resultado de aprendizaje de la materia	Evidencias
as. Investiga con seriedad la realidad socioeconómica de los países, utilizando con solvencia métodos cuantitativos y modelos econométricos.	
-• Aplica modelos econométricos en el análisis macroeconómico y microeconómicos.	-Evaluación escrita -Trabajos prácticos - productos
eco. Aplica modelos econométricos	
-• Aplica modelos econométricos en las investigaciones transversales, series de tiempo y datos de panel.	-Evaluación escrita -Trabajos prácticos - productos

Desglose de evaluación

Evidencia	Descripción	Contenidos sílabo a evaluar	Aporte	Calificación	Semana
Evaluación escrita	Todos los capítulos		APORTE	8	Semana: 5 (18/04/22 al 23/04/22)
Trabajos prácticos - productos	Resolución de ejercicios		APORTE	2	Semana: 5 (18/04/22 al 23/04/22)
Trabajos prácticos - productos	Resolución de ejercicios		APORTE	2	Semana: 10 (24/05/22 al 28/05/22)
Evaluación escrita	Capítulos 3 y 4		APORTE	8	Semana: 10 (24/05/22 al 28/05/22)
Trabajos prácticos - productos	Resolución de ejercicios		APORTE	2	Semana: 15 (27/06/22 al 02/07/22)
Evaluación escrita	Capítulos 5 y 6		APORTE	8	Semana: 15 (27/06/22 al 02/07/22)
Evaluación escrita	Todos los capítulos		EXAMEN	20	Semana: 17-18 (10-07-2022 al 23-07-2022)
Evaluación escrita	Todos los capítulos		SUPLETORIO	20	Semana: 19 (al)

Metodología

Criterios de Evaluación

5. Referencias

Bibliografía base

Libros

Autor	Editorial	Título	Año	ISBN
GUJARATI DAMODAR N. - PORTER DAW C.	McGrawHill	ECONOMETRÍA	2009	978-607-10-3971-7
WILLIAM GREENE	Prentice Hall	ECONOMETRIC ANALYSIS	2003	
V. L. MARTIN, A. S. HURN AND D. HARRIS	Cambridge University Press	ECONOMETRIC MODELLING WITH TIME SERIES	2013	
GUJARATI, DAMODAR, DAWN PORTER	Mc Graw Hill	PRINCIPIOS DE ECONOMETRÍA	2006	

Web

Software

Bibliografía de apoyo

Libros

Web

Autor	Título	URL
Pindyck, Robert	Econometría: Modelos y Pronósticos	http://site.ebrary.com/lib/uasuyasp/detail.action?
Banco Central del Ecuador	Banco Central del Ecuador	https://www.bce.fin.ec/
Instituto Nacional de Estadísticas y Censos	INEC	www.ecuadorencifras.gob.ec

Software

Autor	Título	URL	Versión
STATA	STATA		15.1
R Foundation	R Project for Statistical Computing		4.1.1
Eviews	Eviews		10

Docente

Director/Junta

Fecha aprobación: **14/03/2022**

Estado: **Aprobado**