



FACULTAD DE CIENCIAS DE LA ADMINISTRACIÓN ESCUELA DE ECONOMÍA

1. Datos generales

Materia: ECONOMETRÍA III
Código: ECN0019
Paralelo: A
Periodo : Marzo-2022 a Agosto-2022
Profesor: FREIRE PESANTEZ ANDREA ISABEL
Correo electrónico: afreire@uazuay.edu.ec

Nivel: 6

Distribución de horas.

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

Prerrequisitos:

Código: ECN0014 Materia: ECONOMETRÍA II

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 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.

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

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. Objetivos de Desarrollo Sostenible



4. Contenidos

1.1	Estrategia para la modelización de funciones no lineales
1.2	Funciones no lineales de una sola variable independiente
1.3	Interacciones entre variables independientes
2.1	Modelo lineal de probabilidad
2.2	Modelo Logit: Estimación y ejercicios
2.3	Modelo Probit: estimación y ejercicios
3.1	Conceptos fundamentales

3.2	Procesos estocásticos estacionarios y no estacionarios
3.3	Proceso estocástico de raíz unitaria
3.4	Proceso estocásticos estacionarios en tendencia y en diferencias
3.5	procesos estocásticos integrados
3.6	Regresiones espurias
3.7	Pruebas de estacionariedad
3.8	Pruebas de Raíz unitaria
3.9	Cointegración y pruebas de cointegración
3.10	Mecanismo de corrección de errores
4.1	Diferentes enfoques de Pronósticos económicos
4.2	Modelos Arma: Procesos autoregresivo y de medias móviles
4.3	Modelos Autoregresivos integrado de Medias móviles
4.4	Metodología Box-Jenkins: Identificación, estimación, exámen de diagnóstico y pronóstico
4.5	Modelos de Vectores autoregresivos (VAR)
4.6	Estimación de un modelo VAR
4.7	Cuántas variables deben incluirse en un VAR y determinación de longitud de retardos
4.8	VAR y causalidad
4.9	Pronóstico con el modelo VAR
5.1	Modelos Arch: Identificación, estimación y pronóstico
5.2	Modelos Garch: Identificación, Estimación y pronóstico
6.1	¿Por qué datos Panel? Ejemplos de datos panel balanceado y desbalanceado
6.2	Panel Balanceado y desbalanceado, Corto y largo

5. 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	MODELOS DE REGRESIÓN NO LINEALES, REGRESIÓN CON VARIABLE DEPENDIENTE DICOTÓMICA: LOGIT Y PROBIT	APORTE	8	Semana: 5 (18-ABR-22 al 23-ABR-22)
Trabajos prácticos - productos	Resolución de ejercicios	MODELOS DE REGRESIÓN NO LINEALES, REGRESIÓN CON VARIABLE DEPENDIENTE DICOTÓMICA: LOGIT Y PROBIT	APORTE	2	Semana: 5 (18-ABR-22 al 23-ABR-22)
Evaluación escrita	Capítulos 3 y 4	ECONOMETRIA DE SERIES DE TIEMPO Y PRONÓSTICOS, INTRODUCCIÓN A LA REGRESIÓN DE SERIES TEMPORALES	APORTE	8	Semana: 10 (24-MAY-22 al 28-MAY-22)
Trabajos prácticos - productos	Resolución de ejercicios	ECONOMETRIA DE SERIES DE TIEMPO Y PRONÓSTICOS, INTRODUCCIÓN A LA REGRESIÓN DE SERIES TEMPORALES	APORTE	2	Semana: 10 (24-MAY-22 al 28-MAY-22)
Evaluación escrita	Capítulos 5 y 6	REGRESIÓN CON DATOS DE PANEL, VOLATILIDAD EN SERIES DE TIEMPO FINANCIERAS	APORTE	8	Semana: 15 (27-JUN-22 al 02-JUL-22)
Trabajos prácticos - productos	Resolución de ejercicios	REGRESIÓN CON DATOS DE PANEL, VOLATILIDAD EN SERIES DE TIEMPO FINANCIERAS	APORTE	2	Semana: 15 (27-JUN-22 al 02-JUL-22)
Evaluación escrita	Todos los capítulos	ECONOMETRIA DE SERIES DE TIEMPO Y PRONÓSTICOS, INTRODUCCIÓN A LA REGRESIÓN DE SERIES TEMPORALES, MODELOS DE REGRESIÓN NO LINEALES, REGRESIÓN CON DATOS DE PANEL, REGRESIÓN CON VARIABLE DEPENDIENTE DICOTÓMICA: LOGIT Y PROBIT, VOLATILIDAD EN SERIES DE TIEMPO FINANCIERAS	EXAMEN	20	Semana: 17-18 (10-07-2022 al 23-07-2022)
Evaluación escrita	Todos los capítulos	ECONOMETRIA DE SERIES DE TIEMPO Y PRONÓSTICOS, INTRODUCCIÓN A LA REGRESIÓN DE SERIES TEMPORALES, MODELOS DE REGRESIÓN NO LINEALES, REGRESIÓN CON DATOS DE PANEL, REGRESIÓN CON VARIABLE DEPENDIENTE DICOTÓMICA: LOGIT Y PROBIT, VOLATILIDAD EN SERIES DE TIEMPO FINANCIERAS	SUPLETORIO	20	Semana: 19 (al)

Metodología

Descripción	Tipo horas
El estudiante, como parte de su trabajo autónomo, deberá realizar las siguientes actividades: 1. Resolución por parte del alumno de ejercicios fuera del aula 2. Revisión bibliográfica fuera del aula y estudio del mismo	Autónomo
Se alternarán clases teóricas y ejercicios prácticos con tareas dirigidas en grupo. La estrategia metodológica se basa en los siguientes pasos: 1. Exposición teórica del profesor sobre el tema 2. Ejemplos prácticos desarrollados por el profesor 3. Refuerzo por parte del profesor	Total docencia

Criterios de evaluación

Descripción	Tipo horas
<p>Resolución de ejercicios, casos y otros (2 puntos): Para la calificación de estos trabajos se considerará:</p> <ol style="list-style-type: none">1. Presentación: el trabajo deberá presentarse en carpeta plástica, sin manchas, borrones o con corrector, recuerde que es un trabajo universitario.2. Resolución de todos los ejercicios3. Todos los ejercicios deben contener interpretación/análisis así el texto no lo pida. Además estas interpretaciones/análisis deben realizarse una adecuada redacción y ortografía. Se reducirá el valor de 0.10 puntos por cada ejercicio que no cumpla con este criterio.4. Ortografía: por cada dos faltas de ortografía se reducirá el valor de 0.15 puntos a su trabajo. <p>El plagio y la copia se consideran una falta grave que significará tener una nota de cero y la solicitud correspondiente, por parte del profesor, a las autoridades de la Universidad para que sea sancionado el estudiante de acuerdo a los Reglamentos de la Universidad del Azuay.</p>	Autónomo

<p>Las evaluaciones escritas estarán conformadas por ejercicios prácticos y teoría, esta última, con el objetivo de que los estudiantes dispongan de los conocimientos necesarios para la toma de decisiones. En cuanto a los ejercicios prácticos el valor que se asigne se dividirá 50% a la resolución matemática y 50% a la correcta interpretación y análisis.</p>	Total docencia
---	----------------

6. 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

Revista

Bibliografía de apoyo

Libros

Web

Autor	Título	Url
Pindyck, Robert	Econometría: Modelos y Pronósticos	http://site.ebrary.com/lib/uasuaysp/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**