



ESPECIALIZACION EN ECONOMETRÍA APLICADA

Metodología de la Investigación y la Modelación Econométrica Aplicada

Semestre 2024-I

Eduardo Loría

quijano6919@hotmail.com

<http://www.economia.unam.mx/profesores/eloria/>

y

Emmanuel Salas

salas.emmanuel@gmail.com

7 de agosto al 13 de noviembre de 2023.

I. JUSTIFICACIÓN Y OBJETIVOS GENERALES

Un problema muy común en la enseñanza de las disciplinas universitarias, pero en particular de la economía y de la econometría, es que a pesar de impartirse varios cursos de metodología de la investigación en todos sus niveles (licenciatura, maestría y doctorado), los alumnos presentan serias dificultades para plantear un problema y, consecuentemente para elaborar un proyecto de investigación cuyo producto sea pertinente, concreto y útil.

El presente curso tiene cuatro objetivos: 1) impartir la metodología necesaria, eminentemente pragmática, para que a su término los asistentes elaboren un ensayo sólido y estructurado, con el cual además de que acrediten la materia y/o en su caso se gradúen de licenciatura, sienten las bases de la investigación que llevarán en el segundo semestre, 2) manejar los comandos principales del software EVIEWS 10, que es el de uso generalizado en el mundo, 3) impartir los fundamentos de microeconomía y macroeconomía para homogenizar los conocimientos de los alumnos y facilitarles así el planteamiento de un problema económico de investigación, 4) enseñar algunos temas selectos de econometría que no logran revisarse en otros cursos.

II. DINÁMICA DEL CURSO

Las clases se impartirán en línea los lunes de 17:00 a 21:00 hrs. **LA PUNTUALIDAD Y LA ASISTENCIA SON INDISPENSABLES PARA EL BUEN DESARROLLO DEL CURSO (HABRÁ 10 MINUTOS DE TOLERANCIA PARA ENTRAR A LA SALA). SE EXIGE EL 80% DE ASISTENCIA PARA TENER DERECHO A EVALUACIÓN FINAL.**

Cada clase se dividirá en dos partes, **ambas obligatorias**. La primera será de carácter esencialmente teórica y metodológica, y la segunda tratará sobre un taller de práctica del software y de teoría económica.

III. CALENDARIO

El curso tiene una duración aproximada de 15 sesiones, del 7 de agosto de 2023 al 13 de noviembre de 2023.

IV. EVALUACIÓN

Por su naturaleza, el curso tendrá evaluaciones parciales que consistirán en tareas (20%), exámenes (30%) y la entrega de un trabajo final (50%) que será el producto de la investigación que se realizará durante el semestre. Es indispensable presentar el trabajo final para poder ser evaluado.

ESTE CURSO TIENE CARACTERÍSTICAS GENERALES, POR LO QUE TAMBIÉN LO SERÁN LAS EVALUACIONES; LO CUAL QUIERE DECIR QUE NO SE HARÁN EVALUACIONES PARTICULARES NI COMPENSATORIAS, NI MUCHO MENOS A PARTIR DE CASOS O SITUACIONES ESPECIALES O CONSIDERACIONES INDIVIDUALES.

V. ÍNDICE TEMÁTICO

1) El proyecto econométrico.

- i) Utilidad del proyecto.
- ii) Elaboración del proyecto. Buenas y malas preguntas.
- iii) Diseño del proyecto.
- iv) El proceso de la investigación.
- v) Presentación del reporte final.

Bibliografía:

- ❖ Loría, E., Magaña, P. y Salas, E. (2022). *LA TESIS. Lo que necesitas saber con un modelo que funciona*. Facultad de Economía UNAM. Cap. 4.
- ❖ Kennedy (2002). Sinning in the Basement: What Are the Rules? The Ten Commandments of Applied Econometrics, *Journal of Economics Surveys*, Vol. 18(4).
- ❖ Loría, E. (2007). *Econometría con aplicaciones*. Ed. Pearson, México. Cap.4.
- ❖ Varian, H. R. (1997). How to build an economic model in your spare time. *The American Economist*, 3-10.

2) Los modelos de investigación y la modelación económica.

- i) La importancia de los modelos macroeconómicos.
- ii) La investigación y la modelación económicas.
- iii) La ciencia y la economía.
- iv) La modelación económica y la científicidad.
- v) El proceso de modelar.
- vi) El papel de los supuestos.

Bibliografía:

- ❖ Friedman, M. (1953). The Methodology of Positive Economics. *Essays in Positive Economics*. University of Chicago Press.
- ❖ Loría, E. (2007). Caps. 1 y 2.
- ❖ Hendry, D. (1980). Econometrics: Alchemy or Science? *Economica*, 47. Reprinted in Hendry, D. (1993). *Econometrics: Alchemy or Science?* Blackwell Publishers and Oxford University Press.

3) Tópicos de Econometría Uniecuacional (MCO)

- i) Formas Funcionales.
- ii) Análisis y discusión de parámetros, tasas marginales, elasticidades, semielasticidades etc.
- iii) Cambio Estructural, naturaleza y problemas.
 - Prueba de Quandt-Andrews.
 - Prueba de Bai-Perron.
 - Modelo Threshold

Bibliografía:

- ❖ Andrews, D. (1993). Tests for parameter instability and structural change with unknown change point. *Econometrica* Vol 61(4), 821–856.
- ❖ Bai, J. & Perron, P. (2003). Computation and Analysis of Multiple Structural Change Models, *Journal of Applied Econometrics*, Vol 18(1), 1–22.

4) Análisis avanzado de hechos estilizados.

- i) Análisis gráfico.
- ii) Medias condicionales.
- iii) Regresión Categórica.

Bibliografía:

- ❖ Loría, E., Magaña, P. y Salas, E. (2022). Cap. 6.
- ❖ Loría, E. y Salas, E. (2019). México: Reforma Laboral 2012: una formalización empobrecedora. *Revista Chilena de Economía y Sociedad*, vol. 13(1). Facultad de Administración y Economía, Universidad Tecnológica Metropolitana, Santiago de Chile.

5) Teoría Microeconómica.

- i) Teoría del Consumidor.
 - Preferencias y función de demanda.
 - Elasticidad y tipos de bienes.
 - Elección racional, externalidades.
 - Pérdida del excedente del consumidor.
- iv) Teoría del productor.
 - La frontera de posibilidades de producción.
 - Los costos, fijos, variables y marginales.
 - La competencia perfecta.
 - Excedente del productor.

Bibliografía:

- ❖ Parkin, M. y E. Loría (2015). *Microeconomía, versión para Latinoamérica*. Décimo primera edición, Editorial Pearson. Capítulos 2, 3, 4, 10, 11, 12.

6) Teoría Macroeconómica.

- i) Medición del PIB.
 - Enfoque del Gasto.
 - Enfoque del Ingreso.

- ii) Crecimiento Económico.
 - Cálculo de la tasa.
 - PIB Potencial.
 - Teorías del crecimiento.
- iii) Inflación y desempleo.
 - Definiciones.
 - Mediciones.
 - Curva de Phillips.
- iv) Oferta Agregada y Demanda Agregada.
 - Enfoque clásico.
 - Enfoque keynesiano.
- v) Política Monetaria.
 - Objetivo y marco de la Política Monetaria.
 - Conducción de la Política Monetaria.
 - Transmisión de la Política Monetaria.

Bibliografía:

- ❖ Parkin, M. y E. Loría (2015). *Macroeconomía, versión para Latinoamérica*. 11^a primera edición, Editorial Pearson. Capítulos 21, 22, 23, 27, 29 y 31.
- ❖ Taylor, J. B. (2000). Teaching modern macroeconomics at the principles level. *American Economic Review*, 90(2), 90-94.

7) Taller de comandos de E-VIEWS 10

- i) Creación de un archivo de trabajo.
- ii) Exportación de datos de Excel a EViews 10.
- iii) Exploración básica de los datos: Gráficas, diagramas de dispersión, estadísticas básicas de las series, obtención de correlaciones y covarianzas.
- iv) Uso de comandos básicos y declaración de objetos.
- v) Uso de bases de datos científicas.

Bibliografía:

- ❖ IHS Markit (2017). *Users Manual*. Disponible en https://www3.nd.edu/~nmark/FinancialEconometrics/EViews10_Manuals/EViews%2010%20Users%20Guide%20I.pdf