


FORMATO MODALIDAD PRESENCIAL

	UNIVERSIDAD NACIONAL AUTÓNOMA DE MÉXICO FACULTAD DE ECONOMÍA	
Plan de estudios		

Programa Econometría II
--

Clave	Semestre	Créditos	Area	Economía
	Séptimo	7	Campo de conocimiento	Economía Matemática
			Ciclo	Básico

Modalidad	Curso (X) Taller () Lab () Sem ()	Tipo	T () P () T/P (X)
------------------	---	-------------	----------------------------

Carácter	Obligatorio (X) Optativo () Obligatorio E () Optativo E ()	Horas
-----------------	--	--------------

		Semana	Semestre
	Teóricas	3	Teóricas 48
	Prácticas	1	Prácticas 16
	Total	4	Total 64

Seriación: Si (X) No () Obligatoria () Indicativa (X)	
Asignatura antecedente	Econometría II
Asignatura subsecuente	

Objetivo general: Al finalizar el curso, el alumno será capaz de construir modelos econométricos, con base en la metodología apropiada al modelo en cuestión, mediante el uso de software especializado.

- Objetivos específicos:**
- Comprender y especificar modelos de sección cruzada de elección binaria
 - Especificar, estimar y evaluar modelos de probabilidad lineal
 - Comprender la estructura y especificación de modelos econométricos que consideran variables con datos panel
 - Estudiar modelos de datos panel de componente de error
 - Especificar y estimar modelos de datos panel dinámico
 - Especificar y estimar modelos de datos panel con variable dependiente discreta

Indice temático			
	Tema	Horas Semestre	
		Teóricas	Prácticas
1.	Modelos de probabilidad lineal.	6	2
2.	Modelos de probabilidad no lineal.	9	3
3.	Econometría de datos panel.	9	3
4.	Modelos de datos de panel con componentes de error.	9	3
5.	Modelos de datos panel dinámicos.	9	3
6.	Modelos de datos panel para variables dependientes discretas.	6	2
Total		48	16
Suma total de horas			64

Contenido Temático	
Tema	Subtemas
1. Modelos de probabilidad lineal.	1.1 Modelos de variable dependiente binaria o cualitativa 1.1.1 Modelo de Probabilidad Lineal (MPL) 1.1.2 Supuestos y estimación del MPL por Mínimos Cuadrados ordinarios (MCO)
2. Modelos de probabilidad no lineal.	2.1 Modelo de regresión Probit 2.1.1 Especificación del modelo y estimación por máxima verosimilitud 2.1.2 Interpretación de los coeficientes 2.1.3 Inferencia estadística y bondad de ajuste 2.1.4 Especificación: Análisis de sensibilidad y especificad, heteroscedasticidad y estabilidad de los estimadores 2.2 Modelo de regresión Logit. 2.2.1 Especificación del modelo y estimación por máxima verosimilitud 2.2.2 Interpretación de los coeficientes 2.2.3 Inferencia estadística y bondad de ajuste 2.2.4 Comparación Probit vs Logit 2.2.5 Análisis e interpretación del efecto marginal
3. Econometría de datos panel.	3.1.3.1 Unidades de sección cruzada y series de tiempo 3.1.1 Estructura de los modelos de datos panel 3.1.2 Ventajas y desventajas de los modelos de datos panel

	<ul style="list-style-type: none"> 3.1.3 Heterogeneidad no observada 3.2 Modelo Panel Lineal <ul style="list-style-type: none"> 3.2.1 Estimación por mínimos cuadrados ordinarios (POLS) 3.2.2 Propiedades asintóticas de los estimadores POLS 3.2.3 Supuesto de exogeneidad 3.2.4 Contraste datos en panel vs ecuaciones individuales (pruebas F)
<p>4. Modelos de datos de panel con componentes de error.</p>	<ul style="list-style-type: none"> 4.1 Modelos de efectos fijos <ul style="list-style-type: none"> 4.1.1 Correlación variables explicativas y efectos no observados 4.1.2 Propiedades asintóticas de los estimadores de efectos fijos 4.1.3 Estimación en primeras diferencias 4.1.4 Estimación por variables "dummy" (LSDV) 4.1.5 Estimación por transformación "Within" 4.1.6 Transformación "Within" y estimación robusta 4.2 Modelos de efectos aleatorios <ul style="list-style-type: none"> 4.2.1 No correlación entre variables explicativas y efectos no observados 4.2.2 Propiedades asintóticas de los estimadores de efectos aleatorios 4.2.3 Estimación por mínimos cuadrados generalizados (GLS) y mínimos cuadrados generalizados factibles (FGLS) 4.2.4 Estimación de la varianza del componente no observado: POLS y Within 4.2.5 Estimación por máxima verosimilitud 4.3 Pruebas de hipótesis en modelos de datos panel <ul style="list-style-type: none"> 4.3.1 Pruebas de efectos individuales: Breusch-Pagan LM para efectos aleatorios 4.3.2 Prueba de razón de máxima verosimilitud 4.3.3 Prueba de Hausman efectos fijos vs efectos aleatorios 4.3.4 Heteroscedasticidad 4.3.5 Autocorrelación 4.3.6 Estimación GLS con heteroscedasticidad y autocorrelación
<p>5. Modelos de datos panel dinámicos.</p>	<ul style="list-style-type: none"> 5.1 Modelos autorregresivos de panel con efectos individuales <ul style="list-style-type: none"> 5.1.1 Propiedades asintóticas de los estimadores en modelos panel dinámicos 5.1.2 Estimador por variables instrumentales

Perfil Profesiográfico	
Título o grado	Profesional titulado en la Licenciatura en Economía o carreras afines al área de matemáticas. Deseable haber realizado estudios de posgrado.
Experiencia docente	Contar con experiencia docente o haber participado en cursos o seminarios de iniciación en la práctica docente.
Otra característica	
Bibliografía básica:	
1. Baltagi, B. H. (2013), <i>Econometric Analysis of Panel Data</i> . 5th edition, Ed. John Wiley. Estados Unidos.	
2. Cameron, A. C. y P. K. Trivedi (2005), <i>Microeconometrics: Methods and Applications</i> , Cambridge University Press, New York. Estados Unidos.	
3. Cameron A. C. y P. K. Trivedi (2010), <i>Microeconometrics Using Stata. Publicado por Stata Press</i> . Estados Unidos.	
4. Greene, W. (2005), <i>Econometric Analysis</i> , 5th edition, Prentice-Hall International.	
5. Wooldridge, J. M. (2010), <i>Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data</i> , MIT Press, Cambridge MA. Estados Unidos.	
6. Hsiao, C. (2014), <i>Analysis of Panel Data</i> , Cambridge University. Estados Unidos.	
Bibliografía complementaria:	
1. Ramírez, María Delfina (2014), <i>Econometría con estimaciones para México</i> . UNAM, Facultad de Economía, México.	
2. Sánchez Barajas, Genaro y Bustamante Lemus, Carlos (2014), <i>Econometría básica: con las nuevas tecnologías de la educación del conocimiento aplicadas al análisis económico</i> . UNAM, Facultad de Economía, México.	

VALIDO PARA FINES
DISTINTOS AL INTERCAMBIO
DE OPINIONES ENTRE ÁREAS
ACADÉMICAS