

OBJETIVO GENERAL:

Discutir las características teóricas de los métodos econométricos disponibles, lo cual es de fundamental importancia para elegir óptimamente las técnicas a utilizar en el trabajo propio, y para evaluar críticamente el trabajo de otros.

CONTENIDO

1. Introducción
 - Naturaleza Del Análisis De Regresión.
 - Clasificación de los modelos Econométrico
 - Generalidades del modelo de regresión lineal clásico.

2. Modelo lineal de ecuaciones simultáneas
 - Definiciones y notación.
 - Forma estructural y forma reducida.
 - Problema de identificación.
 - Condiciones de orden y rango
 - Sesgo e inconsistencia del estimador MCO de las ecuaciones de la forma estructural.
 - Estimación de las ecuaciones estructurales: estimadores de variables instrumentales y mínimos cuadrados en dos etapas (MC2E).

3. Modelos de Regresión No Lineales
 - Especificación. Pruebas sobre formas funcionales.
 - Aproximación lineal. Mínimos Cuadrados No lineales. Propiedades.
 - Máxima Verosimilitud. Transformación de Box-Cox.
 - Pruebas de hipótesis y restricciones paramétricas.

4. Modelos de variable dependiente limitada.
 - Modelos de respuesta binaria. Modelo de probabilidad lineal, modelo
 - Probit y modelo Logit. Estimación e inferencia. Efectos parciales.
 - Medidas de la bondad del ajuste.

- Modelos de alternativas múltiples.
 - Modelos de regresión truncados y censurados. Métodos de estimación.
 - Modelos de selectividad
5. Regresión con variables no-estacionarias. Regresión espuria. Cointegración. Modelos de corrección del error. Estimación e Inferencia.
6. Modelos Lineales Univariados. Raíces Unitarias y Cointegración. Vectores Autorregresivos . Técnicas de Regresión para Series de Tiempo, Modelos Estocásticos No-Lineales, Pronósticos con modelos de series de tiempo, Evaluación y combinación de pronósticos.
7. Procesos no estacionarios.
- Procesos estacionarios alrededor de una tendencia (TS) versus procesos integrados (DS).
 - Contrastes de raíz unitaria Dickey-Fuller. Cambio estructural. Predicción.
8. Modelos de Volatilidad condicional.
- Modelos ARCH , GARCH y X-GARCH

BIBLIOGRAFÍA

Asteriou, D. y Stephen G. Hall (2007). "Applied Econometrics a Modern Approach", Revised Edition, Palgrave Macmillan.

Berndt, Ernst R. (1996). "The practice of econometrics: classic and contemporary", Addison Wesley, Reading Massachusetts.

Brockwell, P. y R. Davis (2002), "Introduction to Time Series and Forecasting", Springer-Verlag, Segunda edición.

Diebold, F. (2001), "Elements of Forecasting". South-Western. Segunda edición. [Versión en español, Elementos de Pronóstico. Editorial Paraninfo, 1999].

Enders, W. (2003), "Applied Econometric Times Series". John Wiley. Segunda edición.

Greene Williams H. (1999), "Análisis Económico". 3ª Ed. Prentice Hall.

Hamilton, J. (1994), "Time series analysis". Princenton Univesity Press.

Hun Myoung Park (2009), "Linear Regression Models for Panel Data Using SAS, Stata, Limdep and SPSS". Indiana University – University Information Technology Services.

Maddala, G., (1992), "Introduction to Econometrics". Macmillan, 2ª. Ed. , New York.

Johnston J. y Dinardo J., (1997), "Econometric Methods". 4tª Ed. Mc Graw Hill.

Judge et al., (1982), "An Introduction to the Theory and Practice of Econometrics". New York: John Wiley and Sons.

Koop, G. (2005), "Analysis of Economic Data". Second edition. Wiley.

Mills, T.C. (1999), "The Econometric Modelling of Financial Time Series". Cambridge University Press.

Perez, C. (2006), "Problemas Resueltos de Econometría", Thompson.

Perez, C. (2006), "Econometría de las Series Temporales". Pearson-Prentice may.

Stock, J. y M. Watson (2003), "Introduction to Econometrics". Addison-Wesley.

Wooldridge, J. (2002), "Econometrics: A Modern Approach". Segunda edición. South-Western. [Versión en español: Introducción a la Econometría: un enfoque moderno. 2004]

Wooldridge, Jeffrey M. (2002). "Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data", MIT Press.

INSTRUMENTOS DE EVALUACIÓN

Dos exámenes parciales, uno a mitad del curso (30% de la nota del curso) y otro al final (30%).

El segundo examen no es acumulativo. Un proyecto empírico al final (30%). Trabajos prácticos (10%).

Estos trabajos se basan en ejercicios teóricos, aplicaciones empíricas, lectura y análisis de trabajos recientes (preferentemente sobre la economía mexicana).

NOTA: Los trabajos prácticos y el proyecto empírico pueden ser elaborados en equipos de dos.