



Universidad Nacional Jorge Basadre Grohmann
Facultad de Ciencias Agropecuarias
Escuela Académico Profesional de Economía Agraria



Syllabus del curso Econometría II

a

Información General

- Departamento Académico de: Economía agraria
- Facultad de: Ciencias agropecuarias
- Escuela Académico Profesional de: Economía agraria
- Nombre de la asignatura: Econometría II
- Régimen del curso: Semestral (2013-II)
- Duración del curso: 16 semanas
- Horas de clase: 05 (tres horas teóricas y dos horas prácticas)
- Profesor del Curso: MSc. Ing. Edwin Ismael Palza Chambe

b

Objetivos del curso

- **Objetivo General**
El alumno al término del curso deberá:
Entender el proceso de predicción sobre la base del uso de modelos de abstracción de relaciones causales y su aplicación a las actividades productivas agrarias.
- **Objetivos Específicos**
 - Desarrollar y aplicar los métodos de análisis de regresión simple y múltiple para la elaboración de pronósticos.*
 - Desarrollar y aplicar el análisis de series de tiempo para elaborar pronósticos*
 - Construir modelos de pronósticos válidos para inferir el comportamiento de variables económicas.*

C

Sumilla del curso

El curso planteara:

Asignatura del área de formación de especialidad, con carácter teórico práctico, que tiene por finalidad: estructurar análisis conducente a la construcción especializada de modelos estadísticos que permitan explicar el comportamiento de variables económicas. El curso abarcará la revisión de tópicos como: Manejo de paquetes; Modelos Econométricos de Series de Tiempo, Modelos Uniecuacionales y Multiecuacionales. La asignatura incluye el análisis y contrastes de raíces unitarias, cointegración y modelos de corrección de error, así como también los procesos ARCH y GARCH. Luego se desarrolla a nivel

básico los modelos de variables dependientes limitadas: logit, probit y valor extremo y finalmente se estudian los modelos datos de panel.

d Metodología de evaluación

La evaluación de la asignatura se desarrollará considerando los siguientes instrumentos:

- i. Exámenes Parciales
- ii. Prácticas de laboratorio
- iii. Trabajos Prácticos y de Aplicación
- iv. Seminarios y Exposiciones
- v. Participación en clase

La nota final del curso (NF), se fija sobre la base vigesimal (0-20), la misma que es obtenida a partir de:

- **Criterios conceptuales**

Aplicación de (03) Exámenes Parciales, cuyo promedio determinará el 60% de la Nota Final del curso

- **Criterios procedimentales**

Aplicación de 4 Prácticas de laboratorio, cuyo promedio representa el 20% de la Nota Final del curso

Requerimiento de 02 Trabajos Prácticos y de Aplicación así como su respectiva exposición, cuyo promedio representa el 20% de la Nota Final del curso

Sólo tendrán derecho de evaluación conceptual, los estudiantes que cumplan con haber asistido mínimo al 70% de las clases dictadas de la Asignatura.

(Artículo 25 del Reglamento del currículo de estudios de la FCAG)

La nota mínima para aprobación del curso es de 10,5

e Metodología de enseñanza

A fin de lograr un mejor desarrollo del aprendizaje, se emplearán permanentemente las siguientes estrategias metodológicas:

- i. Conferencia o clase magistral
- ii. Dinámica grupal
- iii. Prácticas individuales
- iv. Evaluación y análisis de resultados
- v. Seminarios

f Programa de clases

- **Primera Unidad Didáctica: ANALISIS DE SERIES DE TIEMPO**

Duración: 08 semanas

Competencias específicas

- i. *El estudiante entiende y comprende los procesos de análisis y vinculación de variables*

- ii. El alumno aplica plenamente las técnicas comunes de relación causal entre variables
- iii. El estudiante usa y entiende la potencialidad de uso de relaciones causales como medio para formular pronósticos.

Contenidos programados:

Conceptual	Procedimental	Actitudinal	Programación
1. Introducción a la modelización de series de tiempo	Comprende las características de un modelo de serie de tiempo	Propone situaciones en las que es factible desarrollar relaciones causales con modelos de series de tiempo	1º semana
2. Efecto de la tendencia, cíclico, estacional, estacional y aleatorio	Establece con claridad las diferencias de conceptos y sus alcances	Manifiesta interés por el desarrollo y aplicación de conceptos con casos cotidianos de variables económicas	2º semana
3. Formulación de pronósticos con series de tiempo	Analiza los alcances de un proceso de vinculación de variables básicamente cuantitativas como medio de abstracción de una relación causal	Plantea alcances y limitaciones del proceso de análisis regresional de series de tiempo	3º y 4º semana

- **Segunda Unidad Didáctica: CONSTRUCCION DE OTRO TIPOS DE MODELOS REGRESIONALES**

Duración: 08 semanas

Competencias específicas

- i. Desarrollar y aplicar otros métodos de análisis de regresión para la elaboración de pronósticos.
- ii. El alumno aplica plenamente las técnicas de construcción de otros modelos regresionales a nivel.
- iii. El estudiante usa y entiende el uso de otros modelo regresional para el cálculo de un pronóstico.

Contenidos programados

Conceptual	Procedimental	Actitudinal	Programación
1. Modelos multiecuacionales, especificación y supuestos, contrastes de hipótesis	Comprende las características de un modelo multiecuacional	Propone situaciones en las que es factible desarrollar relaciones causales con modelos multiecuacionales	1º a 4º semana
2. Modelos Logit, Probit, VAR, predicción y análisis de causalidad	Establece con claridad las diferencias de conceptos y sus alcances	Manifiesta interés por el desarrollo y aplicación de conceptos con casos cotidianos de variables económicas	5º a 8º semana



Bibliografía propuesta

- ANÁLISIS ESTADÍSTICO PARA LA TOMA DE DECISIONES EN ADMINISTRACIÓN Y ECONOMÍA, José Salinas.
- ECONOMETRÍA, Dadomar Gujaratti, 6º Edición, 1997.

- ESTADÍSTICA, Autores Varios, Editorial Schaum, 1998.
- ESTADÍSTICA APLICADA A LA ADMINISTRACIÓN Y LA ECONOMÍA, Leonard Kazmier. México, Editorial Mc Graw Hill, 2º Edición, 1990.
- ESTADÍSTICA DESCRIPTIVA E INFERENCIAL, Manuel Cordova Zamora. Lima, Editorial Moschera, 4º Edición, 2001.
- PROBABILIDADES E INFERENCIA ESTADÍSTICA, Rufino Moya y Gregorio Saravia. Lima, Editorial San Marcos, 2º Edición, 1996.
- PROYECCIONES ESTADÍSTICAS, Sergio Martínez Valenzuela. Lima, Editorial San Marcos, 1º Edición, 1999.
- MATEMÁTICAS APLICADAS PARA ADMINISTRACIÓN, ECONOMÍA Y CIENCIAS SOCIALES, Frank S. Budnick. México, Editorial Mc Graw Hill, 3º Edición, 1998.