

Los Elementos para la evaluación del examen extraordinarios son los siguientes:

1. Temario. Examen Teórico. Se realizará a la hora agendada, se trata de un examen de opción múltiple

2. Trabajo final sobre de un modelo econométrico. Se entregarán los lineamientos para ser entregado en la fecha de examen.

Lineamientos del Proyecto Final

Fecha: septiembre/2018

Instrucciones

El modelo econométrico consistirá en realizar un modelo de regresión lineal múltiple (o simple según sea el caso) en donde se trate de explicar verazmente el comportamiento de un modelo de interés (se recomienda algún modelo relacionado).

La metodología deberá ser de alguno de los siguientes temas:

- Modelo Lineal clásico considerando todas las pruebas conocidas de Normalidad, Heteroscedasticidad, Multicolinealidad y Autocorrelación.
- Modelo de sistemas de Ecuaciones Simultáneas.

Guion de trabajo del Proyecto

- 1.-Introducción (debe incluir objetivo e hipótesis)
- 2.-Revisión de la Literatura
- 3.-Marco teórico
- 4.-Metodología
- 5.- Estimación del modelo y Análisis
- 6.- Conclusiones y recomendaciones
- 7.- Referencias
- 8.-Anexos Estadísticos (versión electrónica de las bases)

Entrega

El informe del proyecto deberá entregarse el día programado para el examen extraordinario a las 19 hrs, en el salón 313 de la Facultad de Economía.

Deberá incluir el documento por escrito, más un cd/usb que incluya: el documento electrónico, la información de las bases de datos utilizadas, así como el modelo en el programa utilizado para su estimación.

Reglas

De acuerdo con las reglas clásicas de las revistas especializadas internacionales en lengua hispana. En específico se siguen las reglas generales de "Trimestre económico", la principal revista latinoamericana de economía y a fines.

1. Los trabajos deberán estar escritos en español o inglés. (No hay puntos extras por uno u otro)
2. Los trabajos se entregarán en LaTeX o similares (Word para Windows o Rich Text Format) y deben cumplir con los siguientes requerimientos: una extensión entre 7000 y 10000 palabras incluyendo notas al pie y referencias; espacio sencillo; letra times new roman de 12 puntos; papel tamaño carta y márgenes de 3 cm. Se entregará impreso, en hojas limpias y engargolado.
3. Los artículos deben incluir un resumen del trabajo, con una extensión máxima de 150 palabras por idioma. Es necesario especificar cuatro o cinco palabras clave en español y en inglés, y cuatro o cinco códigos de clasificación de la nomenclatura JEL. (Journal of Economic Literature)
4. Se requiere que los cuadros y gráficas sean legibles, con las convenciones muy definidas, que se cite su fuente de información en la parte inferior. El flagelar información, tablas, cuadros y gráficas queda estrictamente prohibido, en caso de existir el trabajo será anulado por completo. Ello obedece a la forma de actuar de revistas especializadas formales.
5. Los encabezamientos de cada sección se escribirán en negritas, alineados a la izquierda y en mayúscula sostenida. Los títulos de segundo nivel se escribirán en negritas, alineados a la izquierda, y combinando mayúsculas y minúsculas. Los títulos de tercer nivel irán en itálica, alineados a la izquierda, y combinando mayúsculas y minúsculas.
6. Las ecuaciones deben estar numeradas de manera consecutiva y entre corchetes ([1]; [2]; [3] : :). Esta numeración debe estar alineada a la derecha de la página.
7. Los símbolos matemáticos deben ser muy claros y legibles. Los subíndices y superíndices deben estar correctamente ubicados.
8. Si el documento propuesto incluye citas textuales, es necesario seguir las siguientes indicaciones: si posee cinco líneas o menos irá precedida de dos puntos y entre comillas; si poseen más de cinco líneas se ubicará en un párrafo aparte, a 4 centímetros del borde izquierdo de la hoja, con letra times new roman tamaño 11 y alineado a la derecha.
9. Las notas de pie de página serán, exclusivamente, de carácter aclaratorio o explicativo, no deben incluir referencias bibliográficas.
10. Para emplear una sigla o una abreviatura se indicará su equivalencia completa y a continuación, entre paréntesis, el término que será utilizado en el resto del documento.
11. Las referencias al interior del texto deben conservar el estilo autor-fecha (López, 1998). Cuando la referencia se hace textualmente, el número de la página de donde se tomó debe ir después de la fecha, separado por coma (López, 1998, 52), si incluye varias páginas (López 1998, 52-53) y en caso de varios autores (López et al., 1998).
12. La bibliografía debe enlistar solamente las fuentes citadas en el trabajo, por lo tanto, la sección se titula Referencias bibliográficas y debe seguir estrictamente el estilo APA (American Psychological Association)

Universidad Nacional Autónoma de México
Facultad de Economía
Extraordinario
Econometría I

Profr. Elías Araujo Arcos

I.- Objetivo General

La Econometría comprende el análisis cuantitativo (matemático y estadístico) de fenómenos económicos a través de un conjunto de datos y partir de ellos verificar hipótesis teóricas con base en la evidencia empírica.

El objetivo del curso de Econometría es dar una introducción a la naturaleza del análisis de regresión univariado y multivariado; así como las implicaciones prácticas y teóricas que tienen la violación de los supuestos de los modelos que se analizarán durante el curso. Además, se busca proporcionar las bases cuantitativas necesarias para estudiar y estimar los modelos económicos y financieros más utilizados en los paquetes estadísticos E-views y Stata, así como en Excel.

II.- Metodología

La técnica de enseñanza-aprendizaje básica consiste fundamentalmente en el método de proyectos. Esta estrategia permitirá que los alumnos lleven a cabo un trabajo final en el que puedan desarrollar y aplicar las habilidades y conocimientos adquiridos en el curso. La clase se compone de una parte teórica y otra aplicada-operativa (software) donde se presentan ejemplos y casos; sin embargo, lo más importante en el curso es la interpretación e intuición de los resultados obtenidos.

III.- Temas del Curso

0.-Temas Generales.

Fuentes
Instrumentos
Bases
Herramientas

1.-Introducción.

Esquema general de la Econometría
Introducción a la Estadística Inferencial
Naturaleza de las variables cuantitativas y cualitativas.
Indicadores estadísticos
Propiedades Estadísticas de los Estimadores

2.- Modelos de Regresión Simple.

Naturaleza de los modelos.
Supuestos del modelo clásico de regresión lineal.
Estimadores y parámetros.
Inferencia y pruebas de hipótesis.

3.-Modelo de Regresión Múltiple.

Tipos de modelos.
Coeficiente de determinación múltiple R^2 y la bondad del ajuste.
Incorporación de variables dummy o indicadoras.
Estimación de los parámetros.
Intervalos y pruebas de hipótesis.

Pruebas de hipótesis múltiples
Prueba F.
Transformaciones, selección de variables, R^2 ajustado.
Variable Dummy: Efecto de interacción.

4.-Principales Violaciones a los Supuestos del Modelo de Regresión Lineal Clásico estimado por MCO.

El problema de la Heteroscedasticidad.
El problema de la Multicolinealidad.
El problema de la Autocorrelación.
El problema de la violación al supuesto de normalidad
Outliers y Observaciones Influyentes.

5.-Modelos de Ecuaciones simultaneas.

Naturaleza de los Modelos de Ecuaciones Simultáneas.
El Problema de Identificación.
Condiciones de Orden y de Rango
Métodos de Estimación: Mínimos Cuadrados en 2 y 3 Etapas.
Sistema de Ecuaciones Aparentemente No-Relacionadas

IV. Referencias Bibliograficas.

Referencias básicas:

- Carter R. Hill, George Judge, William Griffiths; *Undergraduate Econometrics*, 2da. Edición, John Wiley & Sons 2000.
- Gujarati, Domar; *Basic Econometrics*, 4ta Edición, Editorial McGraw-Hiill, 2003.
- Greene, William H.; *Econometric Análisis*, 2da. Edition, Prentice Hall, 1990.
- Pindyck, R.S., and D. Rubinfeld; *Econometric Models and Economic Forescast*, McGraw-Hill, 1984.

Datos de contacto: elarar@hotmail.com

Septiembre 2018