

<b>Nivel de formación</b>	Maestría	<b>Pre-requisito</b>	Métodos estadísticos II
<b>Área de formación</b>	ESPECIALIZANTE	<b>Carga horaria</b>	60 hrs.
<b>Clave</b>	Por definir	<b>Créditos</b>	6

### Objetivo general

El curso busca que los estudiantes entiendan y usen las herramientas para analizar los problemas económicos, financieros y de políticas públicas usando datos estadísticos. Específicamente, se ofrece una introducción a los fundamentos, metodologías y técnicas de la econometría aplicada. Asimismo, se estudian los problemas estadísticos de los datos, su detección y su corrección.

### Objetivos específicos

Que, el alumno comprenda:

- El origen, significado y usos de la econometría en la economía, las finanzas y las políticas públicas
- Los supuestos del modelo de regresión lineal clásico, las técnicas de estimación asociadas a dicho modelo y la manera de interpretar los resultados.

Los problemas asociados a la violación de los supuestos del modelo de regresión, su diagnóstico y su corrección

### Criterios de evaluación

La evaluación depende de tres exámenes parciales y un trabajo de investigación final. La calificación final es una media ponderada de la calificación en cada uno de los

exámenes y el trabajo de investigación (25%). Para presentar los exámenes parciales es requisito indispensable haber presentado, todas las tareas que correspondan.

El trabajo final deberá abordar econométricamente un tema relacionado con la la economía, las finanzas y las políticas públicas. El trabajo deberá incluir:

- A. Introducción
- B. Revisión de la literatura
- C. Base de datos y análisis estadístico
- D. Análisis econométrico
- E. Conclusiones
- F. Referencias bibliográficas

Se deberán incluir cuadros y gráficos para apoyar el texto y anexos estadísticos.

## Contenido temático

Sesión (es)	Tema	Descripción
1	Introducción a la estadística y econometría.	Comprenderá los fundamentos del análisis de regresión
2	Regresión lineal de dos variables	Comprenderá los fundamentos de los modelos de regresión
3	Modelos de 2 variables y contrastación de hipótesis	Comprenderá los fundamentos del método de mínimos cuadrados ordinarios
4	Modelo de regresión lineal múltiple	Comprenderá los fundamentos del modelo clásico de regresión lineal múltiple
5	Examen Parcial	
6	Formas funcionales de los métodos de regresión I	Comprenderá los fundamentos del análisis de la forma funcional y el cambio estructural
7	Formas funcionales de los métodos de regresión II	Comprenderá los fundamentos del análisis de la forma funcional y el cambio estructural
8	Modelos de regresión con variables dummy	Comprenderá los fundamentos del análisis econométrico con variables cualitativas
9	Análisis de especificación y selección de modelo	Comprenderá los fundamentos del análisis de especificación y selección de modelo
10	Examen Parcial	
11	Multicolinealidad.	Comprenderá el problema de la multicolinealidad, su detección y solución

12	Heteroscedasticidad.	Comprenderá el problema de la heteroscedasticidad, su detección y solución
13	Correlación serial.	Comprenderá el problema de la correlación serial, su detección y solución
14	Examen Parcial	
15	Exposición de trabajo de investigación	
16	Evaluación Final	

## Bibliografía del curso

- Gujarati, D.N., Porter, D.C. & Pal, M. (2021), Basic Econometrics. Sexta edición. Mc-Graw Hill. ISBN 978-93-90219-29-2
- Gujarati, D.N. & Porter, D.C. (2009), Essentials of Econometrics. Cuarta edición. Mc-Graw Hill. ISBN 978-0-07-337584-7

## Bibliografía complementaria

- Greene, W.H. (2018). Econometric Analysis. Octava edición. Pearson. ISBN 978-0134461366
- Judge, George G., et. al. (1988). Introduction to the Theory and Practice of Econometrics. Segunda edición, John Wiley & Sons. ISBN 978-0-471-62414-1.
- Kennedy, P.N. (2008). *A Guide to Econometrics*. Sexta edición. Wiley-Blackwell. ISBN 978-1405182577
- Wooldridge, J.M., (2019), Introductory Econometrics: A Modern Approach. Séptima edición. Cengage Learning. ISBN 978-1-337-55886-0

## **Sitios web de interés:**

### **Datos económicos y financieros en el mundo:**

<http://www.eclac.org/>

<http://www.imf.org/>

<http://www.worldbank.org/>

### **Datos económicos y financieros en México:**

<http://www.banxico.org.mx/>

<http://www.inegi.org.mx/>

<http://www.shcp.gob.mx/>

<http://www.sat.gob.mx/>

### **Revistas académicas con análisis econométricos:**

<http://www.redalyc.org/>

<http://www.estudioseconomicos.com.mx/>