



Casa abierta al tiempo

**UNIVERSIDAD AUTÓNOMA METROPOLITANA**

UNIDAD <b>IZTAPALAPA</b>		DIVISIÓN <b>CIENCIAS SOCIALES Y HUMANIDADES</b>		1 / 2
NOMBRE DEL PLAN <b>LICENCIATURA EN ECONOMIA</b>				
CLAVE <b>224221</b>	UNIDAD DE ENSEÑANZA-APRENDIZAJE <b>SERIES DE TIEMPO II</b>			CREDITOS <b>8</b>
H. TEOR. <b>4.0</b>	SERIACIÓN <b>224220</b>			TIPO <b>Optativa</b>
H. PRAC. <b>0.0</b>				TRIMESTRE <b>X</b>

**OBJETIVO (S)**

**Objetivo general**

Que al final del curso el alumno y la alumna sean capaces de conocer los modelos macro-económicos para el análisis y evaluación de política económica. Asimismo, de desarrollar las habilidades necesarias para resolver problemas de acuerdo a los contenidos del programa, utilizando paquetería de informática y base de datos.

**Objetivos específicos**

Que al final del curso el alumno y la alumna sean capaces de:

1. adquirir los conocimientos sobre los nuevos métodos del análisis multivariado de series de tiempo.
2. conocer y reflexionar críticamente acerca del debate de la modelación econométrica, en especial sobre los modelos macro-económicos de corte keynesiano.
3. realizar las pruebas de raíz unitaria y desarrollen los métodos de co-integración en dos etapas.
4. realizar el análisis de series de tiempo multivariado con modelos de vectores auto regresivos VAR.
5. adquirir las habilidades para el manejo de las herramientas informáticas adecuadas, en concreto del paquete econométrico E-views 5.0.

**CONTENIDO SINTÉTICO**

1. Series de tiempo análisis multivariado. Modelos econométricos y realidad económica. Crítica a la econometría tradicional. Las nuevas propuestas de la econometría de series de tiempo.
2. Introducción a ecuaciones simultaneas. Microeconomía oferta y demanda en competencia perfecta. Macroeconomía el modelo de Phillips. Algebra matricial de los sistemas de ecuaciones. Identificación de modelos. Condiciones de orden y de rango en la identificación.

NOMBRE DEL PLAN	LICENCIATURA EN ECONOMIA	2 / 2
CLAVE 224221	SERIES DE TIEMPO II	

3. Estimación de modelos econométricos. Métodos estimación. Mínimos cuadrados en dos etapas. Modelo estructural y modelo en la forma reducida. Análisis Grafico de modelos estructurales. Modelos macro-económicos con E-views.
4. Raíz unitaria y cointegración. Métodos de raíz unitaria y relaciones de cointegración. Modelo de cointegración y metodología de lo general a lo particular. Método de dos etapas para identificar relaciones de cointegración. Modelos de corrección de error y equilibrio en economía. Vectores autorregresivos, análisis de modelos de transmisión monetaria.

#### **MODALIDADES DE CONDUCCIÓN DEL PROCESO DE ENSEÑANZA-APRENDIZAJE**

El profesor explicará el desarrollo de algún concepto, técnica o proceso, presentará ejemplos y abrirá un espacio para plantear preguntas y dudas. Posteriormente, aplicará ejercicios o problemas, que de manera individual, en equipo o el grupo en su conjunto, resolverán poniendo en práctica los conocimientos adquiridos, o bien, utilizando además un bagaje más amplio. El profesor promoverá el uso de la lógica, la argumentación y la creatividad.

Exposiciones del profesor incorporando nuevas técnicas de enseñanza, discusiones grupales dirigidas y laboratorios de resolución de problemas, utilizando paquetería de información y bases de datos.

Asesoría del profesor, con discusión individual y colectiva de los resultados obtenidos.

#### **MODALIDADES DE EVALUACIÓN**

Global:

Incluirá evaluación terminal y/o evaluaciones periódicas. Estas evaluaciones podrán realizarse a través de pruebas escritas u orales diseñadas y aplicadas y laboratorios de ejercicios.

Recuperación:

Podrá incluir un trabajo y/o una evaluación escrita que se hará con base en los contenidos del programa y puede ser de todo el curso o de una parte (que deberá entregarse en la fecha señalada en el calendario de recuperación de evaluación aprobado por el Consejo Académico).

#### **BIBLIOGRAFÍA NECESARIA O RECOMENDABLE**

- Guerrero, V., 1991; *Análisis Estadístico de Series de Tiempo Económicas*, México: UAM-Iztapalapa
- Gujarati, Damodar ,1997 *Econometría Básica*, 4<sup>ra</sup>. Edición, McGraw-Hill
- Maddala , 1996; *Econometría*. 2da.. Edición, Mc Graw-Hill