

SÍLABO

Econometría 2

Código	ASUC01249	Carácter	Obligatorio
Prerrequisito	Econometría 1		
Créditos	4		
Horas	Teóricas	2	Prácticas 4
Año académico	2022		

I. Introducción

Econometría 2 es una asignatura de especialidad, de carácter obligatorio, se ubica en el séptimo periodo de la Escuela Académica Profesional de Economía. Tiene como prerrequisito Econometría 1. La asignatura desarrolla, a nivel intermedio, la competencia transversal Administración de Operaciones y TI y la competencia específica Modelo Econométricos. En virtud de lo anterior, su relevancia se fundamenta en aplicar métodos cuantitativos, tecnologías de información y simulaciones en la administración de operaciones y las diferentes áreas de la organización, también diseñar modelos econométricos de acuerdo con el entorno, a través del uso adecuado de métodos cuantitativos y cualitativos.

Los contenidos que la asignatura contiene son los siguientes: modelos de vectores autorregresivos, procesos estacionarios, análisis bayesiano, filtro de Kalman, modelos no estacionarios en series de tiempo, procesos con raíz unitaria, cointegración, cambio de régimen.

II. Resultado de aprendizaje de la asignatura

Al finalizar la asignatura, el estudiante será capaz de aplicar los métodos cuantitativos y tecnologías de información en la administración de operaciones, a un nivel intermedio, evaluando las relaciones entre las variables y las teorías económicas a un nivel logrado.

III. Organización de los aprendizajes

Unidad 1 Modelos univariantes de series de tiempo		Duración en horas	24
Resultado de aprendizaje de la unidad:	Al finalizar la unidad, el estudiante será capaz de explicar procesos estocásticos univariantes mediante modelos de series de tiempo estacionarios y no estacionarios.		
Ejes temáticos:	<ol style="list-style-type: none"> 1. Procesos estocásticos estacionarios 2. Modelos AR y Modelos MA 3. Modelos ARIMA 4. Procesos estocásticos no estacionarios 		

Unidad 2 Elaboración y pronóstico con modelos ARIMA		Duración en horas	24
Resultado de aprendizaje de la unidad:	Al finalizar la unidad, el estudiante será capaz de interpretar modelos de series de tiempo mediante la metodología de Box Jenkins para la realización de pronósticos de procesos estocásticos.		
Ejes temáticos:	<ol style="list-style-type: none"> 1. Identificación y estimación de modelos ARIMA 2. Diagnóstico y criterios de información 3. Pronósticos con modelos ARIMA 4. Heteroscedasticidad condicional autorregresiva 		

Unidad 3 Modelos de series de tiempo multivariantes estacionarios		Duración en horas	24
Resultado de aprendizaje de la unidad:	Al finalizar la unidad, el estudiante será capaz de interpretar modelos macroeconómicos estructurales mediante modelos de retardos distribuidos y de vectores autorregresivos.		
Ejes temáticos:	<ol style="list-style-type: none"> 1. Modelos ARMA con perturbación 2. Modelos de retardos distribuidos 3. Modelo de vectores autorregresivos (VAR) 4. Funciones de reacción 		

Unidad 4 Modelos de series de tiempo multivariantes no estacionarios		Duración en horas	24
Resultado de aprendizaje de la unidad:	Al finalizar la unidad, el estudiante será capaz de aplicar modelos macroeconómicos estructurales, a través de vectores auto regresivos no estacionarios y procesos de cointegración.		
Ejes temáticos:	<ol style="list-style-type: none"> 1. Raíces unitarias y contraste de raíces unitarias 2. Modelos VAR con raíces unitarias 3. Cointegración 4. Elaboración de modelos multivariantes 		

IV. Metodología

Modalidad presencial:

De acuerdo con los contenidos y actividades propuestas, se desarrollará siguiendo la secuencia teórico-práctica, se hará uso de la metodología colaborativa que implique actividades tales como:

- Análisis y solución de casos y ejercicios
- Aprendizaje basado en problemas
- Clase magistral activa
- Trabajo colaborativo promoviendo los debates en el desarrollo de casos

Asimismo, el estudiante hará uso del material de trabajo para la realización de los casos prácticos, se realizará la investigación bibliográfica e investigación vía internet.

V. Evaluación

Modalidad Presencial

Rubros	Unidad por evaluar	Fecha	Entregable / Instrumento	Peso parcial	Peso Total
Evaluación de entrada	Prerrequisito	Primera sesión	- Evaluación individual teórica / Prueba de desarrollo	0%	
Consolidado 1 C1	1	Semana 1 - 4	- Ejercicios grupales de aplicación para identificar problemas / Rúbrica de evaluación	40%	20%
	2	Semana 5 - 7	- Evaluación individual teórico-práctica / Prueba de desarrollo	60%	
Evaluación parcial EP	1 y 2	Semana 8	- Evaluación individual teórico-práctica / Prueba de desarrollo	25%	
Consolidado 2 C2	3	Semana 9 - 12	- Ejercicios grupales de aplicación para identificar problemas / Rúbrica de evaluación	40%	20%
	4	Semana 13 - 15	- Trabajo práctico / Rúbrica de evaluación	60%	
Evaluación final EF	Todas las unidades	Semana 16	- Trabajo práctico y exposición / Rúbrica de evaluación	35%	
Evaluación sustitutoria *	Todas las unidades	Fecha posterior a la evaluación final	- Aplica		

* Reemplaza la nota más baja obtenida en los rubros anteriores.

$$PF = C1 (20\%) + EP (25\%) + C2 (20\%) + EF (35\%)$$

VI. Bibliografía**Básica:**

Hamilton, J. (1994). *Time series analysis*. Princeton University Press. <http://bit.ly/2JiAiHS>

Complementaria:

Greene, W. (2003). *Econometric analysis*. (5.ª ed.). Prentice Hall.

Johnston, J., Dinardo, J. (1997). *Econometric methods*. (4.ª ed.). McGraw-Hill.

VII. Recursos digitales:

Quantitative Micro Software (QMS) (version 11) [software] (2019). *Econometric View*.