



**Pontificia Universidad Javeriana – Cali**  
**Facultad de Ciencias Económicas y Administrativas**  
**Carrera de Economía**

---

### 1. Descripción de la Asignatura

Nombre	Econometría II
Código	300CSE006
Prerrequisitos	Econometría I
Créditos Académicos	3
Horas de clase /semana	4
Horas de Trabajo Independiente a la semana	5

### 2. Presentación

La econometría como rama de la economía que integra: teoría económica, estadística y las matemáticas, permite validar empíricamente teorías económicas, estima cuantitativamente las relaciones entre variables económicas, compara diferentes teorías sobre el mismo fenómeno y predice valores de ciertas variables económicas más allá de la dimensión temporal de la muestra. En esta medida la econometría se convierte en una herramienta fundamental para el futuro economista. En este curso de econometría se presentan algunos supuestos que rigen a los modelos de regresión que no fueron tratados en el curso de econometría I y las extensiones del modelo de regresión múltiple que le permitan al estudiante ampliar el campo de aplicación de la econometría. Adicionalmente se introduce algunos temas avanzados de la econometría, como datos de panel y test de raíces unitarias, de tal manera que el estudiante tenga una visión de los desarrollos modernos de esta disciplina. El curso enfatiza en las aplicaciones de las diferentes técnicas tratadas tomando como punto de partida la teoría económica

### 3. Objetivo(s) de formación

Al finalizar el curso el estudiante podrá aplicar las extensiones del modelo lineal en el análisis de variables socioeconómicas, de manera que relacione y cuantifique la teoría económica con la realidad empírica, evaluando el impacto, los efectos, las perspectivas y prospectivas que de dicha relación se deriven, tanto a corto, mediano y largo plazo. La aplicación de dichas extensiones del modelo se realizará a la luz del análisis de una correcta especificación. Específicamente se desarrollan los siguientes objetivos de formación:

Estudiar detalladamente las características de un buen modelo y la forma de especificarlo correctamente en la práctica

Construir, analizar y aplicar modelos de regresión con variables explicatorias cualitativas, a situaciones reales de la economía colombiana.

Construir, analizar y aplicar modelos dinámicos de regresión, a las situaciones reales de la economía colombiana, tanto a corto mediano como a largo plazo.

Construir, analizar y aplicar modelos simultáneos de regresión, acordes con los mercados de bienes y servicios, laboral, monetario, financiero y de interrelación mutua, tanto a corto mediano como a largo plazo para la economía colombiana.

Aplicar algunos test de raíces unitarias como elemento fundamental dentro del diseño de un modelo econométrico

#### **4. Competencias.**

Las competencias que se espera sean adquiridas con el desarrollo del curso son:

Capacidad de interpretar y comprender información econométrica contenida en artículos y documentos económicos. Esta competencia se logra a partir de la lectura de artículos en revistas especializadas, en los cuales se utilizan las técnicas tratadas en esos momentos en el curso

Capacidad de formular y modelar relaciones entre variables económicas en un contexto dado. Esta competencia se desarrolla a través de la aplicación de los temas tratados en un problema de la vida real.

Desarrollar destrezas en la utilización de software econométrico, además de poder trabajar en grupo. Esta competencia se alcanza con las diferentes aplicaciones que se hacen a lo largo del semestre utilizando los paquetes econométricos. Eviews y Stata. Adicionalmente los parciales exigen el manejo de cualquiera de los dos paquetes econométricos utilizados a lo largo del curso. La competencia de trabajo en grupo se desarrolla, a partir del desarrollo de un trabajo aplicado a lo largo de todo el semestre.

## 5. Contenido.

Sesión	Contenido Temático	Práctica Pedagógica	Horas Presenciales	Horas Trabajo Independiente	Referencias Bibliográficas
1	Presentación del curso	Clase magistral	2		
2	<b>Especificación</b> Omisión de variables relevantes  Inclusión de variables irrelevantes	Clase magistral	2	5	Gujarati D. Cap. 13  Maddala. Cap. 12
3	<b>Continuación</b> Mala forma funcional  Selección de modelos	Clase magistral	2	2.5	Gujarati D. Cap. 13  Maddala. Cap. 12
4	Ejercicios aplicados	Taller	2	2.5	
5	<b>Examen corto 1</b> <b>Variables Dicotómicas</b> Introducción  Una variable cualitativa explicatoria  Más de una variable cualitativa explicatoria	Quiss y clase magistral	2	2.5	Gujarati D. Cap. 9
6	<b>Variables Dicotómicas (Continuación)</b> Modelos semilogaritmicos  Regresión a tramos  Efecto de interacción	Clase magistral	2	2.5	Gujarati D. Cap. 9
7	Ejercicios aplicados	Taller	2	2.5	
8	<b>Examen corto 2</b> <b>Modelos Dinámicos</b> Introducción  El Modelo de Koyck	Quiss y clase magistral	2	2.5	Novales A. Cap. 9  Gujarati D. Cap. 17

9	El modelo de expectativas adaptables.  El modelo de ajuste parcial	Clase magistral	2	2.5	Novales A. Cap. 9  Gujarati D. Cap. 17
10	El modelo de Almón  Test de causalidad de Granger	Clase magistral	2	2.5	Gujarati D. Cap. 17
11	Ejercicios aplicados	Taller	2	2.5	
12	Taller preparatorio primer parcial	Taller	2	5.0	
13	Primer parcial	Primer Parcial	2		
14	<b>Modelos de Variable Dependiente Discreta</b> Modelo de probabilidad lineal  Modelo Logit	Clase magistral	2	2.5	Gujarati D. Cap. 15.
15	Modelo Probit	Clase magistral	2	2.5	Gujarati D. Cap. 15
16	Ejercicios aplicados	Taller	2	2.5	
17	<b>Examen corto 3</b> Introducción a los datos de panel	Quiss y clase magistral	2	2.5	Gujarati Cap. 15
18	Datos de panel continuación	clase magistral	2	2.5	Gujarati Cap. 15
19	Taller preparatorio segundo parcial	Taller	2	2.5	
20	Segundo parcial	Segundo Parcial	2		
21	El problema de las Ecuaciones simultáneas	Clase magistral	2	2.5	Gujarati D. Cap. 18
22	El problema de identificación primera parte	Clase magistral	2	2.5	Gujarati D. Cap. 19

23	El problema de identificación segunda parte	Clase magistral	2	2.5	Gujarati D. Cap. 19
24	Ejercicios aplicados	taller	2	2.5	
25	<b>Examen corto 4</b> Enfoque matricial de las ecuaciones simultáneas. Primera parte	Quiss y clase magistral	2	2.5	Novales A. Cap. 17
26	Enfoque matricial de las ecuaciones simultáneas. Segunda parte	Clase magistral	2	2.5	Novales A. Cap. 17
27	<b>examen corto 5</b> Estimación de las ecuaciones simultáneas	Quiss y clase magistral	2	2.5	Gujarati D. Cap. 20
28	Introducción a las series de tiempo. Primera parte	Clase magistral	2	2.5	Novales A. Cap. 13 Gujarati D. Cap. 21
29	Introducción a las series de tiempo. Segunda parte	Clase magistral	2	2.5	Novales A. Cap. 13 Gujarati D. Cap. 21
30	Introducción a las raíces unitarias y cointegración	Clase magistral	2	2.5	Novales A. Cap. 14 Gujarati D. Cap. 22
31	<b>Examen corto 6</b> Ejercicios aplicados	Quiss y taller	2	2.5	
32	Taller preparatorio examen final	Taller	2	5.0	

## **5. Metodología**

El curso se desarrollará mediante las siguientes estrategias metodológicas.

Exposiciones de los temas por parte del profesor enfatizando la parte teórica. Para que la clase sea aprovechada al máximo los estudiantes deben hacer lectura previa del tema a desarrollar en cada clase.

Programación de talleres con alta responsabilidad y participación de los estudiantes, los mismos se desarrollarán dentro y fuera del salón de clase.

Sesiones prácticas de modelación con datos reales mediante paquetes econométricos (Eviews y Stata).

Acompañamiento de un monitor para las actividades de taller

## **6. Evaluación**

Las valoraciones dadas a los eventos de evaluación serán:

Primer examen parcial	25%
Segundo examen parcial	25%
Examen final	30%
Trabajo aplicado	10%
Exámenes cortos	10%

## **7. Bibliografía**

### **7.1 Bibliografía Básica**

Gujarati D. Porter D. (2010). Econometría, quinta edición. Editorial Mc Graw Hill.

### **7.2 Bibliografía Complementaria**

Fernández A. et. al. (1993). Ejercicios de Econometría. Primera Edición. Mac Graw Hill.

Greene W. (1999). Análisis econométrico. Tercera edición. Editorial Prentice Hall.

Jeffrey m. Wooldrige (2007). . Introducción a la Econometría. Segunda edición. Editorial Thomson Learning.

Johnston J. (1987). Análisis Econométrico. Tercera edición. Editorial Edit Vicen Vives.

Maddala G.S. (1996). Introducción a la Econometría. Segunda edición. Editorial Prentice Hall.

Novales A. (1993). Econometría. Segunda edición. Mc Graw Hill.

Pindyck R. Rubinfeld D.(1998). Econometría: Modelos y pronósticos. Mc Graw Hill.

Rosales A. Ramón. et al. (2010). Fundamentos de econometría intermedia: Teoría y aplicaciones.

[http://economia.uniandes.edu.co/investigaciones\\_y\\_publicaciones/CEDE/Publicaciones/apuntes\\_de\\_clase\\_cede/2010/FUNDAMENTOS](http://economia.uniandes.edu.co/investigaciones_y_publicaciones/CEDE/Publicaciones/apuntes_de_clase_cede/2010/FUNDAMENTOS)

### **Paginas Web y direcciones relacionadas con el curso**

Banco de la Republica

<http://www.banrep.gov.co>

DANE

<http://www.dane.gov.co>

Departamento de Planeación Nacional

<http://www.dnp.gov.co>

FEDESARROLLO

<http://www.fedesarrollo.org.co>

Eviews (paquete econométrico)

<http://www.eviews.com/>

Consortio de Bases de Datos de Bibliotecas Universitarias Colombiana

<http://www.puj.edu.co/vice/biblioteca/index.html>

