



UNIVERSIDAD FERMIN TORO
VICE RECTORADO ACADEMICO
DECANATO DE INVESTIGACIÓN Y POSTGRADO
MAESTRIA EN FINANZAS

PROGRAMA INSTRUCCIONAL

DATOS BASICOS DE LA ASIGNATURA							
Nombre de la asignatura:				Código	Trimestre	U.C.	Pre - Requisito
ECONOMETRIA APLICADA				ECA-282		0	S/P
Tipo de Asignatura:	Nivelatoria	Obligatoria	Electiva	DENSIDAD HORARIA			
				H.T	H.P/H.L	H.A	THS/Trim
Profesores especialistas:				Elaborado por:			
LIC. DALMIRO MOYA				LIC. DALMIRO MOYA			
FECHA DE VIGENCIA	REVISADO POR DECANATO			AUTORIZADO POR VICE RECTORADO ACADÉMICO			
ENERO, 2000							
	(FIRMA Y SELLO)			(FIRMA Y SELLO)			

FUNDAMENTACION

La Econometría consiste en la combinación de métodos estadísticos, económicos y datos para responder a preguntas sobre cuestiones económicas empíricas.

La Econometría es importante en prácticamente todas las ramas de la economía aplicada: laboral, salud, industrial, macroeconomía, desarrollo, internacional, marketing, finanzas, etc.

El estudio empírico del crecimiento y fluctuación del producto necesita de algunas herramientas como lo son los modelos econométricos, estos modelos necesitan especificaciones estadísticas mucho más precisas que los económicos, los modelos económicos resultan ser demasiado generales para ser aplicados a momentos, lugares y actividades económicas concretas, que es lo que se pretende con un modelo econométrico.

OBJETIVO GENERAL DE LA ASIGNATURA

- Se aprenderá las diversas herramientas que pueden ser utilizadas para otros objetivos, como la predicción. Así como también a “producir” (hacer los análisis econométricos) y a “consumir” (evaluar el trabajo de otros).
- Comprender y aplicar los métodos econométricos adecuados a la hipótesis y datos de estudio.
- Identificar posibles problemas en los datos y en las estimaciones, proponiendo soluciones.

UNIDAD I		OBJETIVO TERMINAL	
FUNDAMENTOS DE PROBABILIDAD Y ESTADISTICA PARA MODELACION ECONOMETRICA APLICADA		AL TERMINO EL PARTICIPANTE SERA CAPAZ DE ENTENDERLOS TERMINOS BASICOS DE ESTADISTICA DESCRIPTIVA, PROBABILIDAD ESTADISTICA DIFERENCIAL, CORRELACION Y REGRESION LINEAL SIMPLE.	
DURACION			
4 SEMANAS			
EVALUACION			
25%			
OBJETIVOS ESPECIFICOS	CONTENIDO	ESTRATEGIAS DE INSTRUCCION	
1. Concepto de Estadística descriptiva 2. Análisis de problemas económicos. 3. Software moderno estadístico 4. Investigación aplicada	- Series económicas y sus características probabilísticas. - Probabilidad - Esperanza matemática - Variables aleatorias y distribuciones de probabilidad. - Variables aleatorias discretas y continuas - Transformaciones de variables aleatorias. - Series económicas y simulación.	- Exposición del docente. - Análisis de textos. - Discusión guiada.	
ESTRATEGIAS DE EVALUACIÓN:			
- Preguntas y respuestas. - Exposición. - Casos prácticos.			

UNIDAD II		OBJETIVO TERMINAL	
MATEMÁTICAS APLICADAS A LOS MODELOS ECONÓMETRICOS		AL FINALIZAR LA UNIDAD EL PARTICIPANTE PODRA ANALIZAR E INTERPRETAR DE MANERA SOLVENTE LOS PARAMETROS DERIVADOS DE LAS ESTIMACIONES, PROPONER HIPOTESIS PROBABLES A PARTIR DE LA MODELACIÓN ECONÓMETRICA.	
DURACION			
4 SEMANAS			
EVALUACION			
40%			
OBJETIVOS ESPECIFICOS	CONTENIDO	ESTRATEGIAS DE INSTRUCCION	
1. Análisis de multiplicadores, marginal o de elasticidades. 2. Conceptos de lógica y abstracción. 3. Plantear y resolver problemas económicos concretos.	• Elementos de un modelo matemático • Análisis estático comparativo. • Sistema de ecuaciones lineales y matriciales. • Valores y vectores propios. • Formas cuadráticas • Análisis dinámico.	• Exposición del docente. • Análisis de textos. • Discusión guiada.	
ESTRATEGIAS DE EVALUACIÓN:			
• Preguntas y respuestas. • Exposición. • Casos prácticos.			

UNIDAD III		OBJETIVO TERMINAL	
MODELOS DE SERIES Y TIEMPOS		ESPECIFICAR Y ESTIMAR MODELOS ECONÓMETRICOS DE SERIES DE TIEMPO ESTACIONARIAS Y NO ESTACIONARIAS.	
DURACION			
4 SEMANAS			
EVALUACION			
35%			
OBJETIVOS ESPECIFICOS	CONTENIDO	ESTRATEGIAS DE INSTRUCCION	
1. Identificar los componentes de una serie de tiempo. 2. Identificar las características de las series de tiempo estacionarias y no estacionarias. 3. Plantear modelos de series de tiempo. 4. Analizar problemas económicos específicos.	• Componentes básicos de una serie de tiempo. • Método de eliminación y extracción de señales. • Aplicaciones económicas esenciales. • Procesos estocásticos estacionarios. • Procesos estocásticos no estacionarios. • Modelos ARIMA.	• Exposición del docente. • Análisis de textos. • Discusión guiada.	
ESTRATEGIAS DE EVALUACIÓN:			
• Preguntas y respuestas. • Exposición. • Casos prácticos.			

BIBLIOGRAFIA

- Enders. W (1995). **Applied Econometrics Time Series**. Willey. Capítulos 2 y 3.
- Ruiz-Maya. L.P. Martin (1995). **Probabilidad y Estadística**. Editorial AC, Universidad de Madrid.
- Carter,M. (2001). **Foundations of Mathematical Economics**. MIT Press. Cambridge. Todo el libro.
- Guerrero V. (1991). **Análisis Estadístico de Series de Tiempo Económicas**, Pearson Education, México.