



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

---

### 1. Descripción de la Asignatura

Nombre	Econometría II
Código	300CSE006
Ubicación Semestral	VI semestre
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. El curso básico de econometría se divide en: econometría I y econometría II, en la econometría II se discuten extensiones del modelo lineal general que le permitan ampliar el campo de aplicación de elementos fundamentales de los modelos de regresión y los supuestos que los rigen, enfatizando en la aplicación a partir de 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

### **3.1 Objetivos Específicos**

- ✓ 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, acordes con una estructuración teórica adecuada.
- ✓ Construir, analizar y aplicar modelos dinámicos de regresión, a las situaciones reales de la economía colombiana, tanto a corto mediano como a largo plazo, acordes con una estructuración teórica adecuada.
- ✓ 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, acordes con una estructuración teórica adecuada.

### **4. Competencias.**

(Se refiere a las competencias que esta asignatura debe desarrollar en los estudiantes)

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.
- \*Capacidad de formular y modelar relaciones entre variables económicas en un contexto dado
- \*Capacidad de autoaprender mediante la metodología Aprendizaje basado en problemas o PBL
- \*Desarrollar destrezas en la utilización de software econométrico, además de poder trabajar en grupo

## 5. Contenido.

Sesión	Actividad	Tema	Bibliografía
1	Clase magistral	*Introducción *Presentación del curso	
2	Clase magistral	<b>Especificación</b> *Omisión de variables relevantes *Inclusión de variables irrelevantes	*Gujarati D. 2004  Pindyck R. Rubinfeld D.1998
3	Clase magistral	<b>Continuación</b> *Mala forma funcional *Selección de modelos	*Gujarati D. 2004  Pindyck R. Rubinfeld D.1998
4	Taller	Ejercicios aplicados	
5	Clase magistral	<b>Examen corto 1</b> <b>Variables Dicotómicas</b> *introducción *Una variable cualitativa explicatoria *Más de una variable cualitativa explicatoria	Gujarati D. 2004  Pindyck R. Rubinfeld D. 1998.
6	Clase magistral	<b>Variables Dicotómicas (Continuación)</b> *Modelos semilogaritmicos * Regresión a tramos * Efecto de interacción	Gujarati D. 2004  Pindyck R. Rubinfeld D. 1998
7	Taller	Ejercicios aplicados	
8	Clase magistral	<b>Examen corto 2</b> <b>Modelos Dinámicos</b> * Introducción	Fernández A. et. al. 1993

		* El Modelo de Koyck	*Gujarati D.2004
9	Clase magistral	* El modelo de expectativas adaptables *El modelo de ajuste parcial	Fernández A. et. al. 1993 *Gujarati D. 2004.
10	Taller	Ejercicios aplicados	Fernández A. et. al.1993  *Gujarati D. 2004
11	Clase magistral	<b>Continuación</b> * El modelo de Almón *Test de causalidad de Granger	*Gujarati D. 2004
12	Taller	<b>Examen corto 3</b> Taller preparatorio primer parcial	
13	Taller	Taller preparatorio primer parcial	
14	Primer Parcial	Primer parcial	
15	Clase magistral	<b>Modelos de Variable Dependiente Discreta</b> *Modelo de probabilidad lineal *Modelo Logit	*Gujarati D. 2004.  Pindyck R. Rubinfeld D. 1993
16	Clase magistral	*Modelo Probit	*Gujarati D.  Pindyck R. Rubinfeld D. 1998
17	Taller	<b>Examen corto 4</b> Ejercicios aplicados	
18	Taller	Taller preparatorio segundo parcial	
19	Taller	Taller preparatorio segundo parcial	
20	Segundo p Parcial	Segundo parcial	
21	Aprendizaje	PBL	libre

	activo	El problema de las Ecuaciones simultáneas	
22	Aprendizaje activo	PBL El problema de las ecuaciones simultáneas	libre
23	Clase magistral	El problema de las ecuaciones simultáneas	*Gujarati D. 2004
24	Aprendizaje activo	PBL. El problema de identificación	libre
25	Aprendizaje activo	PBL. El problema de identificación	libre
26	Clase magistral	El problema de identificación	Gujarati D. 2004
27	Aprendizaje activo	PBL El problema de identificación matricialmente	Libre
28	Aprendizaje activo	PBL El problema de identificación matricialmente	Libre
29	Clase magistral	El problema de identificación matricialmente	*Novales. 1993  Pindyck R. Rubinfeld D.1998
30	Clase magistral	Introducción a las raíces unitarias	*Gujarati D. 2004  Pindyck R. Rubinfeld D. 1998
31	Taller	Taller preparatorio examen final	
32	Taller	Taller preparatorio examen final	

## 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 un paquete econométrico.

\*Acompañamiento de un monitor para las actividades de taller

\*Adicionalmente, el último tema se desarrollará utilizando la metodología de APRENDIZAJE BASADO EN PROBLEMAS. Esta metodología busca que el estudiante “aprenda a aprender” A través de un problema (escenario) entregado al inicio de cada sesión el estudiante identifica sus necesidades de aprendizaje y las herramientas o habilidades necesarias para poder resolver el problema propuesto. A través del trabajo en pequeños grupos, los estudiantes generan la información necesaria para responder, o para resolver, la tarea o escenario de manera específica.

Una vez el estudiante ha avanzado en la conceptualización para desarrollar el problema, se desarrolla una o varias sesiones tradicionales donde se complementan o aclaran los conceptos adquiridos por los estudiantes

## 6. Evaluación

Las valoraciones dadas a los eventos de evaluación serán:

- Primer examen parcial 25%
- Segundo examen parcial 25%
- Examen final 30%
- Evaluación PBL 10%
- Exámenes cortos 10%

## 7. Bibliografía

### 7.1 Bibliografía Básica

\* Gujarati Damodar , Econometría, cuarta edición. Editorial Mc Graw Hill. 2004

### 7.2 Bibliografía Complementaria

\* Fernández A. et. al. Ejercicios de Econometría. Primera Edición. Mac Graw Hill. 1993

\*. Greene w. Análisis econométrico. Tercera edición. Editorial Prentice Hall.1999

\* Jeffrey m. Wooldrige . Introducción a la Econometría. Editorial Thomson Learning.2001

\*.Johnston J. Análisis Econométrico. Tercera edición. Editorial Edit Vicen Vives. 1987

\* Maddala G.S. Introducción a la Econometría. Segunda edición. Editorial Prentice Hall.1996

\*Novalés A. Econometría. Segunda edición. Mc Graw Hill. 1993

\*.Pindyck R. Rubinfeld d. Econometría: Modelos y pronósticos. Mc Graw Hill. 1998.

### Páginas Web y direcciones relacionadas con el curso

Banco de la República	<a href="http://www.banrep.gov.co">http://www.banrep.gov.co</a>
DANE	<a href="http://www.dane.gov.co">http://www.dane.gov.co</a>
Departamento de Planeación Nacional	<a href="http://www.dnp.gov.co">http://www.dnp.gov.co</a>
FEDESARROLLO	<a href="http://www.fedesarrollo.org.co">http://www.fedesarrollo.org.co</a>
Eviews (paquete econométrico)	<a href="http://www.eviews.com/">http://www.eviews.com/</a>
Consortio de Bases de Datos de Bibliotecas Universitarias Colombiana	<a href="http://www.puj.edu.co/vice/biblioteca/index.html">http://www.puj.edu.co/vice/biblioteca/index.html</a>

