

RESOLUCION N° 1.014/10
EXPEDIENTE N° 6.818/05
Salta, 29 de Octubre de 2.010

VISTO: La planificación presentada por el Lic. Héctor Eugenio Martínez, Profesor Regular Adjunto de la asignatura **Econometría II**, de la carrera de Licenciatura en Economía, Plan de Estudios 2003, para el Período Lectivo 2.010, y;

CONSIDERANDO:

Lo dictaminado por la comisión de Docencia, a fs. 22 vuelta del presente expediente.

Lo dispuesto por el artículo 113, inciso 8 de la Resolución A. U. N° 1/96, Estatuto de la Universidad Nacional de Salta (atribución del Consejo Directivo de aprobar los programas analíticos)

Lo dispuesto por la Resolución N° 420/00 y modificatoria N° 718/02 del Consejo Directivo de esta Unidad Académica, mediante los cuales delega al Señor Decano la atribución antes mencionada.

POR ELLO, en uso de las atribuciones que le son propias,

**EL VICEDECANO DE LA FACULTAD DE CIENCIAS ECONOMICAS
JURIDICAS Y SOCIALES
RESUELVE:**

ARTICULO 1.- TENER POR APROBADA la planificación que obra de fs. 16 - 22, de la asignatura **ECONOMETRIA II**, de la carrera de Licenciatura en Economía, Plan de Estudios 2003, presentada por el Lic. **Héctor Eugenio Martínez**, para el periodo académico 2010, cuyo programa analítico y de examen, bibliografía y régimen de regularidad y promoción obran como Anexo I de la presente Resolución.

ARTICULO 2.- REMITASE COPIA al Director del Departamento de Economía Lic. Carlos Luis Rojas para su conocimiento y demás efectos.

ARTICULO 3.- HAGASE SABER al Lic. **Héctor Eugenio Martínez**, al CEUCE, y a los departamentos de Alumnos e Informática para su toma de razón y demás efectos.

eh
ahl


Cra. EL ZASE TH TRUNINGER de LORE
SECRETARIA ACADÉMICA




Dr. CARLOS GUILLERMO REVILLA
VICE DECANO

ANEXO I (Res. N° 1.014/10)
ECONOMETRIA II

CARRERA: Licenciatura en Economía
PLAN DE ESTUDIOS: 2003
PERIODO LECTIVO: 2010

AÑO DE LA CARRERA: 4°
CUATRIMESTRE: 1°
CARGA HORARIA SEMANAL: 6 horas

PROGRAMA DE CONTENIDOS (ANALÍTICO Y DE EXAMEN)

Tema I: Algoritmos Numéricos de Optimización:

Introducción - La utilidad de los métodos numéricos de optimización en la estimación econométrica - Algoritmo de búsqueda - Algoritmo de Newton-Raphson - Algoritmo de Gauss-Newton - Algoritmo del descenso más rápido.

Tema II: Modelos No Lineales

Introducción - Modelos de regresión lineales vs. no lineales - Mínimos cuadrados no lineales - Estimación de máxima verosimilitud - Transformación a un modelo lineal - La transformación de Box-Cox - Estimación de Parámetros en modelos no lineales.

Tema III: Modelos de Series Temporales

Introducción - Procesos estocásticos estacionarios - Estacionariedad: débil y estricta - Procesos ruido blanco - Procesos de medias móviles (MA) - Invertibilidad - Procesos autorregresivos (AR) - Procesos ARMA (p,q) - Función de autocorrelación y autocorrelación parcial de un proceso estocástico estacionario - Procesos no estacionarios en media y en varianza - Modelos ARIMA (p,d,q) - Formas de detectar no estacionariedad de la serie - Diferenciación - Identificación del modelo, estimación y pruebas de diagnóstico de modelos ARIMA - Predicción - Estacionalidad y modelos SARIMA.

Tema IV: Series Temporales no estacionarias y procesos integrados

Introducción - Procesos estocásticos no estacionarios - Tendencias determinísticas y estocásticas - Caminata aleatoria - Tendencias y ruidos blancos - Modelos en tendencia estacionarios (TS) - Modelos en diferencia estacionarios (DS) - Eliminación de la tendencia diferenciando la serie- Tests de Raíz Unitaria: Dickey - Fuller (DF), Dickey-Fuller Aumentado (DFA) y Phillips-Perron (PP) - Definición de procesos integrados.

Tema V: Regresión con Variables No Estacionarias

Introducción - Regresiones espurias - Relaciones de equilibrio de largo plazo entre variables económicas- Combinaciones lineales de variables integradas - Concepto de cointegración - Vector de cointegración - Estimación del vector de Cointegración - Pruebas de cointegración de variables: Test de Engel y Granger - Construcción del modelo con variables cointegradas - Mecanismo de corrección del error - Término de corrección del error - Método de Engel y Granger en dos etapas - Limitaciones del método.

Tema VI: Datos de Panel

Introducción - Organización de los datos de panel - Estimación por el método de efectos fijos - Efectos fijos con paneles no balanceados - Estimación por el método de efectos aleatorios - Aplicación de métodos de datos de panel a otras estructuras de datos.

Tema VII: Modelos de Variables Dependientes Cualitativas y Limitadas

Introducción - Modelos de respuesta binaria - Dificultades de la regresión estándar para modelos de respuesta binaria - Funciones de transformación: funciones de transformación acumulativa, función índice - Modelo Probit y modelo Logit - Estimación e inferencia - Medidas de la bondad del ajuste - Interpretación de los coeficientes - Modelos para datos truncados o censurados, muestra censurada o muestra truncada - Modelo Tobit - Estimación en muestras censuradas y truncadas. Sesgo de selección muestral.

[Handwritten signatures]



BIBLIOGRAFÍA:

| BIBLIOGRAFÍA BÁSICA | | | |
|----------------------------|--|-------------------|--------------------|
| <i>AUTOR</i> | <i>TÍTULO</i> | <i>EDITORIAL</i> | Lugar y año de ed. |
| Enders, Walter | Applied Econometric Time series | John Wiley & Sons | USA, 2010 |
| Carrascal, Ursicino | Análisis Económico con EViews | Alfaomega RA-MA | México, 2004 |
| Wooldridge, Jeffrey M. | Introducción a la Econometría. Un enfoque moderno. | Thomson Learning | México, 2010 |
| Gujarati, Damodar N. | Econometría | McGraw-Hill | México, 2009 |
| Novalés, Alfonso | Econometría | McGraw-Hill | España, 1993 |

| BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA | | | |
|---|--|--------------------------------|--------------------|
| <i>AUTOR</i> | <i>TÍTULO</i> | <i>EDITORIAL</i> | Lugar y año de ed. |
| Patterson, Kerry | An Introduction to Applied Econometrics: a time series approach. | St. Martin's Press | USA, 2000 |
| Diebold, Francis | Elementos de Pronósticos | International Thomson Editores | México, 1999 |
| Johnston, J. y DiNardo, J. | Econometric Methods | The McGraw Hill Companies | New York, 1997 |
| Kmenta, Jan | Elements of Econometrics | Macmillan | New York, 1971 |
| JUDGE, George G., GRIFFITHS, W. E., HILL, R. Carter, LÜTKEPOHL, Helmut & LEE, Tsoung-Chao | The Theory and Practice of Econometrics - Second Edition | John Wiley & Sons | New York, 1985 |
| Greene, William | Econometric Analysis – Sixth Edition | Prentice Hall | New Jersey, 2008 |
| OTRAS PUBLICACIONES | | | |
| Ninguna | | | |

CRITERIOS Y SISTEMA DE EVALUACIÓN:

La evaluación se realizará mediante dos exámenes parciales, la realización de un trabajo de investigación aplicada y eventualmente un examen final, todos ellos escritos. La escala de clasificación será de 1 a 10. Un examen parcial tendrá lugar a mediados del cuatrimestre y el otro al final del mismo. El trabajo de investigación aplicada se deberá presentar al momento de rendir el segundo examen parcial.

El examen final se tomará en las fechas que las autoridades de la Facultad fijen, en los turnos acostumbrados de examen.

CONDICIONES PARA OBTENER LA REGULARIDAD Y/ O PROMOCIONALIDAD:

PROMOCIÓN: Quienes en los dos exámenes parciales y en el trabajo de investigación aplicada hayan obtenido como mínimo 6 (seis) puntos en cada uno de ellos, habrán promovido la asignatura, sin examen final, y les corresponderá, como nota en ella el promedio obtenido entre las notas de los dos exámenes parciales y del trabajo de investigación aplicada, convenientemente redondeado.

REGULARIDAD: Quienes no promuevan la asignatura como arriba se establece, pueden regularizarla mediante los exámenes parciales y el trabajo de investigación aplicada, para lo que deberán tener aprobados los tres, con 4 (cuatro) puntos o más. A fin de regularizar la asignatura, el alumno podrá recuperar uno de los exámenes parciales, en el que hubiera sido aplazado o hubiere estado ausente y si fuese necesario rehacer el trabajo de investigación aplicada. El examen de recuperación será tomado una semana después del último examen parcial, y versará sobre el tema del examen en que el alumno resultó aplazado o estuvo ausente.

En el caso de haberse tenido que rehacer el trabajo de investigación aplicada, el mismo será entregado en el momento que se tome el examen de recuperación.

Salta, Octubre de 2010

Lic. Héctor E. Martínez

[Handwritten signature]

