

RES. DECECO Nº 643.11
Salta, SEP 2011
EXPEDIENTE Nº 6.818/05

VISTO: La planificación de la asignatura **Econometría II**, presentada por el Lic. Eugenio MARTINEZ, Profesor Regular Adjunto, para la carrera de Licenciatura en Economía, Plan de Estudios 2003, Período Lectivo 2.011, y;

CONSIDERANDO:

Lo dictaminado por la comisión de Docencia, a fs. 34 del presente expediente.

Lo dispuesto por el artículo 113, inciso 8 de la Resolución A. U. Nº 1/96, Estatuto de la Universidad Nacional de Salta (atribución del Consejo Directivo de aprobar los programas analíticos)

Lo dispuesto por la Resolución Nº 420/00 y modificatoria Nº 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.- APROBAR la planificación que obra de fs. 27- 33, de la asignatura **ECONOMETRIA II**, de la carrera de Licenciatura en Economía, Plan de Estudios 2003, presentada por el Lic. Eugenio MARTINEZ, para el periodo académico 2011, cuyo programa analítico y de examen, bibliografía y régimen de regularidad y promoción obran como Anexo I de la presente Resolución.

ARTICULO 2.- HAGASE SABER al Lic. Eugenio MARTINEZ, al Director del Departamento de Economía, Lic. Carlos Luis ROJAS, al CEUCE, y a los departamentos de Alumnos e Informática para su toma de razón y demás efectos.

Ram/ahl




Cra. ELIZABETH TRUNINGER DE LORÉ
Secretaría As. Académicos y de Investigación
Ct. CARLOS GUILLERMO REVILLA
VICE-DECANO

ECONOMETRIA II

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

AÑO DE LA CARRERA: 4º
CUATRIMESTRE: 2º
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.



R
ee
af

BIBLIOGRAFÍA:

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

BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA			
AUTOR	TÍTULO	EDITORIAL	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 Pronosticos	International Thomson Editores	Mexico, 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.



[Handwritten signature]

643-11

Universidad Nacional de Salta
Facultad de Ciencias Económicas,
Jurídicas y Sociales
Avda. Bolivia 5.150 – A4408 FVY Salta Capital

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, Setiembre de 2.011

Lic. Eugenio MARTINEZ
Profesor Regular Adjunto

R
a
h
ca
643.11
J
OT
