



Universidad Nacional de Salta



Facultad de Ciencias Económicas  
Jurídicas y Sociales

"2013 año del Bicentenario De la Asamblea General Constituyente de 1813"

013.14

RES. DECECO N°  
Salta, 03 ENE 2014  
EXPEDIENTE N° 6818/05

**VISTO:** La planificación presentada por el Lic. **Hector Eugenio MARTINEZ**, Profesor Regular Adjunto de la asignatura **ECONOMETRÍA II**, de la carrera de Licenciatura en Economía, Plan de Estudios 2003, para el Período Lectivo 2013, y;

**CONSIDERANDO:**

Lo dictaminado por la Comisión de Docencia, a fs.48, 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 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 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. 40 a 46 de la asignatura **ECONOMETRÍA II**, de la carrera Licenciatura en Economía, , presentada por el Lic. **Hector Eugenio MARTINEZ**, Plán de estudios 2003, para el período académico 2013, 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. **Hector Eugenio MARTINEZ**, a las Direcciones: General Académica; de Alumnos e Informática y al CEUCE para su toma de razón y demás efectos.

*ce*  
03

*Chiozzi*  
Cra. AZUCENA SANCHEZ DE CHIOZZI  
Secretaría As. Académicos y de Investigación  
Fac. Cs. Econ. Jur. y Soc. - UNSa.



*Hugos*  
Dr. HUGO IGNACIO LLIMOS  
VICEDECANO



Universidad Nacional de Salta



Facultad de Ciencias Económicas  
Jurídicas y Sociales

"2013 año del Bicentenario De la Asamblea General Constituyente de 1813"

ANEXO I – RES. DECECO N° 013.14

**ECONOMETRÍA II**

CARRERA: Licenciatura en Economía  
AÑO DE LA CARRERA: 4° (cuarto)  
CARGA HORARIA SEMANAL: 6 (seis) horas  
PLAN DE ESTUDIOS: 2003

CUATRIMESTRE: Primero  
PERÍODO LECTIVO: 2013

**PROGRAMA DE CONTENIDOS (ANALÍTICOS Y DE EXAMEN)**

**Tema I: Modelos No Lineales**

Introducción - Modelos de regresión no lineales - Mínimos cuadrados no lineales - Estimación de máxima verosimilitud - Métodos numéricos de optimización. Método generalizado de los momentos

**Tema II: Modelos de Variables Dependientes Cualitativas y Limitadas**

Introducción - Modelos de respuesta binaria - Modelos para datos multinomiales - Modelos para variables dependientes limitadas - Modelos de duración - Sesgo de selección muestral.

**Tema III: Regresores Estocásticos y Variables Instrumentales**

Introducción - regresión lineal con regresores estocásticos - Propiedades del estimador de mínimos cuadrados - Variables instrumentales (IV)- Propiedades de los estimadores de IV - Pruebas de exogeneidad y validez de instrumento.

**Tema IV: 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 V: Modelos de Series Temporales Estacionarias**

Introducción - Procesos estocásticos estacionarios - Modelos ARMA (p,q) - Identificación, estimación y pruebas de diagnóstico - Predicción.

**Tema VI: Modelos de Series Temporales No estacionarias**

Introducción - Procesos estocásticos no estacionarios - Definición de procesos integrados - Modelos ARIMA (p,d,q) - Raíces Unitarias - Tendencias y estacionalidad.

**Tema VII: Regresión con Variables No Estacionarias**

Introducción - Regresiones espurias - Cointegración - Mecanismo de corrección del error - Modelos VAR y VEC. Función de impulso respuesta - Descomposición de la Varianza.

**Tema VIII: Volatilidad Variable en el Tiempo y Modelos ARCH**

Introducción - Volatilidad variable en el tiempo - Modelos ARCH y G-ARCH - Estimación y pruebas de diagnóstico - Pronóstico de la volatilidad.

**BIBLIOGRAFIA BASICA**

| Autor   | Titulo   | Editorial                 | Lugar y año de edición |
|---|--|---------------------------|------------------------|
| Enders, Walter  | Applied Econometric Time series                                  | John Wiley & Sons         | USA, 2010              |
| Hill C. Grffiths, W. y Lim                              | Principles of Econometrics                                       | John Wiley & Sons         | USA. 2011              |
| Heij C., de Boer P., Frances P., Kloek T. y Van Dijk H. | Econometrics Methods with Applications in Business and Economics | Oxford University Press   | New York, 2004         |
| Berndt, E   | The Practice of Econometrics: classic and contemporary           | Addison Wesley Publishing | USA, 1991              |





Universidad Nacional de Salta



Facultad de Ciencias Económicas  
Jurídicas y Sociales

"2013 año del Bicentenario De la Asamblea General Constituyente de 1813"

013.14

### BIBLIOGRAFIA BASICA

| Autor          | Título  | Editorial        | Lugar y año de edición |
|----------------|---|------------------|------------------------|
| Wooldridge, J. | Introducción a la Econometría. Un enfoque moderno | Thomson Learning | México, 2010           |

### BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA

|                            |   |                                |                  |
|----------------------------|---|--------------------------------|------------------|
| 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   |
| Greene, William            | Econometric Analysis  | Prentice Hall                  | New Jersey, 2008 |

### CRITERIOS Y SISTEMA DE EVALUACION

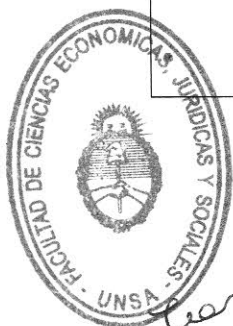
La evaluación se realizará mediante dos exámenes parciales, la realización de un trabajo de investigación aplicada y eventualmente un examen final, todos ellos escritos. La escala de clasificación será de 1 a 10. Un examen parcial tendrá lugar a mediados del cuatrimestre y el otro al final del mismo.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

**PROMOCION:** 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 2013

Lic. Eugenio MARTINEZ  
Profesor Adjunto