



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.



Hugo Ignacio Llimos
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: 4º (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	Título	Editorial	Lugar y año de edición
Enders, Walter	Applied Econometric Time series	John Wiley & Sons	USA, 2010
Hill C. Griffiths, 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

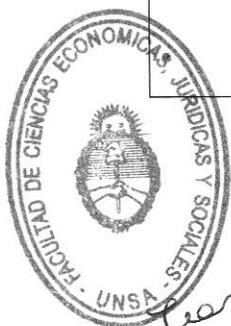
La evaluación se realizará mediante dos exámenes parciales, la realización de un trabajo de investigación aplicada y eventualmente un examen final, todos ellos escritos. La escala de clasificación será de 1 a 10. Un examen parcial tendrá lugar a mediados del cuatrimestre y el otro al final del mismo.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