



Universidad Nacional de Moreno
Departamento de Economía y Administración

06

MORENO, '27 FEB 2014

VISTO el Expediente N° UNM:0000019/2014 del Registro de la UNIVERSIDAD NACIONAL DE MORENO; y

CONSIDERANDO:

Que el REGLAMENTO GENERAL ACADÉMICO, aprobado por Resolución UNM-R N° 37/10 y sus modificatorias, el que fuera ratificado por el Acta de la Sesión Ordinaria N° 01/13 del CONSEJO SUPERIOR de fecha 25 de Junio de 2013, establece el procedimiento para la aprobación de las obligaciones curriculares que integran los Planes de Estudios de las carreras que dicta esta UNIVERSIDAD NACIONAL.

Que conforme lo dispuesto en el citado REGLAMENTO GENERAL, se ha elevado una propuesta de Programa de la asignatura: ECONOMETRÍA (1342), del ÁREA: ESTADÍSTICAS, correspondiente al CICLO DE FORMACIÓN PROFESIONAL de la carrera LICENCIATURA EN ECONOMÍA del DEPARTAMENTO DE ECONOMÍA Y ADMINISTRACIÓN de esta UNIVERSIDAD, aconsejando su aprobación con vigencia a partir del 1er. Cuatrimestre del Ciclo Lectivo 2014.

Que la SECRETARÍA ACADÉMICA de la UNIVERSIDAD ha emitido opinión favorable, de conformidad con lo previsto en

Cuy
6

el artículo 3° de la Parte I del citado REGLAMENTO GENERAL, por cuanto dicho Programa se ajusta a las definiciones enunciadas en el artículo 4° de la Parte I del REGLAMENTO en cuestión, así como también, respecto de las demás disposiciones reglamentarias previstas en el mismo.

Que la SUBSECRETARÍA LEGAL Y TÉCNICA ha tomado la intervención de su competencia.

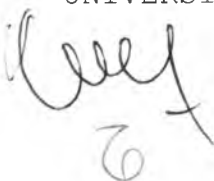
Que el CONSEJO del DEPARTAMENTO DE ECONOMÍA Y ADMINISTRACIÓN, en sesión de fecha 12 de Diciembre de 2013, trató y aprobó el Programa propuesto, conforme lo establecido en el artículo 2° de la Parte I del REGLAMENTO GENERAL ACADÉMICO.

Por ello,

EL CONSEJO DEL DEPARTAMENTO DE ECONOMÍA Y ADMINISTRACIÓN

DISPONE:

ARTÍCULO 1°.- Aprobar el Programa de la asignatura: ECONOMETRIA (1342), del ÁREA: ESTADÍSTICAS, correspondiente al CICLO DE FORMACIÓN PROFESIONAL de la carrera LICENCIATURA EN ECONOMÍA del DEPARTAMENTO DE ECONOMÍA Y ADMINISTRACIÓN de esta UNIVERSIDAD, con vigencia a partir del 1er. Cuatrimestre del





06

Universidad Nacional de Moreno
Departamento de Economía y Administración

Ciclo Lectivo 2014, el que como Anexo I forma parte integrante de la presente Disposición.

ARTÍCULO 2º.- Regístrese, comuníquese, dese a la SECRETARÍA ACADÉMICA a sus efectos y archívese.-

DISPOSICIÓN UNM-DEyA N°06/2014

Handwritten signature and number 6

Handwritten signature
Lic. PABLO ALBERTO JAVILLA
DIRECTOR GRAL. DEL DEPTO.
DE ECONOMÍA Y ADMINISTRACIÓN
UNIVERSIDAD NACIONAL DE MORENO

Universidad Nacional de Moreno
Departamento de Economía y Administración

06

ANEXO I

Universidad Nacional de Moreno
PROGRAMA ASIGNATURA: **ECONOMETRÍA (1342)**

Carrera: LICENCIATURA EN ECONOMÍA (Plan de estudios aprobado por Resolución UNM-R N° 21/10)¹

Área: Estadísticas

Trayecto curricular: Ciclo de Formación Profesional

Período: 1° Cuatrimestre - Año 4

Carga horaria: 128 (ciento veintiocho) horas

Vigencia: A partir del 1° cuatrimestre 2014

Validez: 2 (dos) años

Clases: 32 (treinta y dos)

Régimen: de regularidad o libre

Responsable de la asignatura: Roberto PEREYRA

Programa elaborado por: Roberto PEREYRA

FUNDAMENTACIÓN

La asignatura "Econometría" (1342) es una de las materias del Ciclo de Formación Profesional de la Carrera de LICENCIATURA EN ECONOMÍA y es correlativa de "Matemática para Economistas" (1333). El objetivo central de esta asignatura es proporcionar a los estudiantes las herramientas básicas de la materia en las diversas áreas de aplicación que ésta tiene, para estimar y validar relaciones económicas en base a la información estadística disponible, e identificando tanto las potencialidades como las limitantes del análisis.

OBJETIVOS GENERALES

- Manejar las herramientas básicas de la econometría en la evaluación de las teorías y políticas económicas y las proyecciones macroeconómicas.

¹ Reconocimiento oficial y validez nacional otorgado por Resolución ME N° 1293/12.

Ally
6-

- Diseñar, estimar, corregir e interpretar los resultados de modelos econométricos a nivel micro y macroeconómico.
- Realizar análisis de series de tiempo por diversos métodos. Explicar el caso de la volatilidad.

CONTENIDOS MINIMOS

Modelo Lineal Clásico: regresión con k variables explicativas. Métodos de estimación: Mínimos Cuadrados Ordinarios y Máxima Verosimilitud. El problema del no cumplimiento de los supuestos del Modelo Lineal Clásico: errores en las variables, autocorrelación, multicolinealidad, heteroscedasticidad. Modelos con restricciones en los coeficientes. Modelos con variables cualitativas. Errores de especificación. Modelos autorregresivos y de rezagos distribuidos. El problema de la identificación. Estimación de modelos multiecuacionales. Econometría de series de tiempo. Modelos de rezagos distribuidos. Modelos de series de tiempo con ecuaciones simultáneas, estimadores alternativos. Modelos de vectores autorregresivos, aplicaciones particulares. Aplicaciones específicas de la econometría para el caso argentino y latinoamericano.

PROGRAMA

UNIDAD I

Introducción a la materia. La econometría como herramienta analítica. Inferencia y causalidad. La cláusula *ceteris paribus*. Breve reseña de evolución histórica de la disciplina. Diferentes aplicaciones con: datos de corte transversal; series de tiempo; combinaciones de cortes transversales; y datos de panel.

UNIDAD II

Econometría básica con datos de corte transversal por Mínimos Cuadrados Ordinarios (MCO). Modelos de regresión lineal simple y múltiple. Los supuestos de Gauss-Markov. Propiedades de los estimadores para muestras finitas. Medidas de bondad de ajuste. Uso de variables independientes binarias. Cambio en las unidades de medida. Ejercitación práctica con SPSS y STATA.

Cuy
6

Universidad Nacional de Moreno
Departamento de Economía y Administración

UNIDAD III

Análisis de los residuos. Interpretación de los resultados e inferencia estadística. Violación de los supuestos básicos: heteroscedasticidad. Contrastes de hipótesis: formas de testeo y corrección. Mínimos Cuadrados Generalizados. Mínimos Cuadrados Ponderados. Problemas con los datos y su tratamiento: multicolinealidad; datos faltantes; datos atípicos y observaciones influyentes. Errores de especificación: omisión de variables relevantes e inclusión de variables irrelevantes; Especificación incorrecta de la forma funcional. Testeo de formas alternativas: transformación de Box-Cox. Estimaciones Maxiverosímiles. Ejercitación práctica con SPSS y STATA.

UNIDAD IV

Econometría básica de series de tiempo por MCO. Componentes de una serie temporal: tendencia y estacionalidad. Análisis de regresión en muestras finitas y grandes. Violación de los supuestos básicos: Correlación serial: testeo y formas de corregirla. Series estacionarias y no estacionarias. Modelos ARMA y ARIMA: Identificación, estimación y validación. Predicción. Modelos con rezagos distribuidos. Raíces unitarias. Modelos de Cointegración y de corrección de error. Modelos con Vectores Autorregresivos. Ejercitación práctica con SPSS y STATA.

UNIDAD V

Modelos de regresión con Variables Instrumentales. Modelos multiecuacionales. Utilización de Mínimos Cuadrados en dos Etapas. Endogeneidad y sesgo de selección: uso de variables instrumentales. Pruebas de endogeneidad. Modelos de series temporales con ecuaciones simultáneas: estimación por primeras diferencias. Ejercitación práctica con SPSS y STATA.

UNIDAD VI

Introducción a modelos con variables cualitativas. Modelos de probabilidad lineal. Modelos Logit y Probit: estimaciones maxiverosímiles. Ejercitación práctica con SPSS y STATA.

Ally
10

Bibliografía obligatoria:

- Wooldridge, J. (2011): "Introducción a la econometría. Un enfoque moderno". Cuarta edición. Editorial CENGAGE Learning.
- Caridad y Ocerin, J. (1998): "Econometría: Modelos Econométricos y Series Temporales, Tomo 2: Modelos econométricos multiecuacionales. Predicción económica y series temporales". Primera edición. Editorial Reverté S.A.

Bibliografía complementaria:

- Greene, W. (1999): "Análisis Econométrico". Tercera edición. Editorial Prentice Hall.
- Johnston, J. y Dinardo, J. (2001): "Métodos de econometría". Editorial Vicens Vives, Barcelona.

OBJETIVOS PEDAGÓGICOS:

- Desarrollar la capacidad de comprensión, análisis y evaluación de diferentes estimaciones econométricas.
- Desarrollar la capacidad de formular conceptos y técnicas de econometría a problemas prácticos (estimación, inferencia o predicción), vinculando los resultados obtenidos a la teoría económica e identificando tanto las potencialidades como las limitantes del análisis.
- Promover el espíritu reflexivo sobre las cuestiones que abordarán en sus respectivas formaciones.

OBJETIVOS ACTITUDINALES:

- Participación activa en el proceso de enseñanza-aprendizaje.
- Disposición a superar la perspectiva del sentido común y fundamentar los puntos de vista.
- Enfatizar la adquisición de precisión y eficacia comunicativa en la expresión oral y escrita.

any
6

Universidad Nacional de Moreno
Departamento de Economía y Administración

- Desarrollar disposición hacia el trabajo en equipo.

METODOLOGÍA DE TRABAJO:

El curso cuenta con ocho horas semanales y se desarrollará una clase teórica y una práctica por semana. En las clases teóricas se realizará el desarrollo conceptual de la materia. Con respecto a las clases prácticas, estarán destinadas a la ejercitación con los programas SPSS para Windows, Decision Time/What if (SPSS) y STATA.

EVALUACIÓN Y APROBACIÓN:

La modalidad de evaluación comprende 2 exámenes parciales teóricos-prácticos, escritos y de carácter presencial, comprensivo de los temas abordados mediante la bibliografía obligatoria, y/o complementaria que a tal fin se indique en cada caso. Los mismos se darán por aprobados cuando la nota calificatoria sea de 4 (cuatro) o superior.

El estudiante tendrá derecho a recuperar sólo uno de estos parciales.

Alcanzarán la "promoción" de la materia los alumnos que, además de cumplir con la asistencia pautaada aprueben los 2 parciales (sin recuperar ninguno de ellos) y obtengan un promedio de 7 (siete) puntos o más.

La condición de "alumno regular" (que tendrá que aprobar la materia en examen final) se mantendrá en los casos que, habiendo cumplido con la asistencia requerida, hayan obtenido un mínimo de 4 (cuatro) puntos en cada examen parcial (o en el recuperatorio del que hayan desaprobado).

La condición de "alumno regular", se perderá cuando el alumno no reúna el 80 % de asistencia al curso, o cuando no lograra alcanzar la calificación de 4 (cuatro) o más en cada una de las instancias evaluatorias (incluido el recuperatorio).

Ony
20