

ECONOMETRIA II
2009 -2010

Profesor Titular
Lic. Hugo R. Balacco
Profesora Adjunta
Mónica I. Calderón
Ayte. Graciela Pascucci

1. REQUISITOS

- Economía Monetaria y Economía Internacional Real como correlativas previas (aprobadas)
- Se recomienda el manejo de Inglés a nivel de lectura de textos.

2. OBJETIVOS Y EXPECTATIVAS DE LOGROS

a. Objetivos:

El objetivo perseguido con el programa de Econometría II es el profundizar y principalmente completar los conocimientos adquiridos por los alumnos en Econometría I y Estadística II, sobre todo en lo relativo a regresión con variables no estacionarias. Modelos de varianza condicional y Microeconometría.

- b. Se espera que el alumno complete una formación básica y exigente en econometría.

Luego de haber aprobado Estadística II y Econometría I, es importante completar el manejo de las herramientas básicas de perfil cuantitativo para el ejercicio de la profesión y/o la continuación de estudios de post-grado.

3. CONTENIDO

1. Regresión. Modelo Lineal. Estimación MCO y MCG (mínimos cuadrados generalizados). Sistemas de Ecuaciones (SUR).

2. Mínimos cuadrados recursivos. Propiedades de los residuos recursivos. Residuos CUSUM y CUSUNQ, test correspondientes.
3. Procedimientos generales de selección de Modelos Docimacia de hipótesis (test). Principios de verosimilitud , Wald, y Lagrange. Hipótesis no anidadas. Test de englobamiento.
4. Modelos de series temporales. Modelo ARIMA. Identificación, estimación y pronóstico. Aplicaciones directas en Economía. Modelos de función de transferencia. Análisis de intervención.
5. Modelos con series de tiempo no estacionarias. Test de Dickey Fuller, test ampliado y test de Phillips-Perron. Otros test alternativos.
6. Cointegración y modelo de corrección de errores. Ejemplos y casos de aplicación en economía. Test de cointegración.
7. Variables dependientes cualitativas y limitadas. Modelos de elección discreta. Modelo lineal de probabilidad. Modelo Logit. Modelo Probit. Inferencia en Modelos de elección discreta.
8. Modelos con datos de Panel. Descripción del Modelo. Estimación por Mínimos Cuadrados Generalizados. Efectos fijos y efectos aleatorios. Autocorrelación y Heterocedasticidad.
9. Modelos de varianza condicional. Modelos ARCH y GARCH. Volatilidad en Mercados Financieros. Asimetría. Modelos TARCH y EGARCH. Inferencia y Pronóstico.

4. BIBLIOGRAFIA

GREENE, W., Econometrics Analysis, 3er. ed., Mac Millan Publishing Company, 1999.

GUJARATI, D., Basic Econometrics, Mc Graw Hill, 3ed., 1995.

ENDERS, W., Applied Econometric Time Series, John Willey Sons. Inc., 2° ed., 2004.

HARVEY, A., C., The Econometric Analisis of Times Series, 2° ed., MIT Press, 1991.

JOHNSTON, J. Métodos de Econometría, 3° ed., Vicens Vives, 1992 (2° reimpresión)

STOCK, J. H. y WATSON, M. W., Introduction to Econometrics, 1° ed., Pearson education, Addison Wesley, 2003.

WOOLDRIGDE, J. M., Introducción a la Econometría, 2ª ed., Thomson, 2003.

MADDALA, G.S., Introduction to Econometrics, 2º ed., Mc Millan Publishing Company, 1992.

Observaciones: La bibliografía sugerida es la básica, que se completa durante el dictado de la materia, con trabajos específicos y monografías de aplicación seleccionada en función de los temas bajo estudio.

5. METODOLOGIA DE ENSEÑANZA-APRENDIZAJE

Sobre la base de la “Cátedra magistral”, las clases son teórico-aplicadas, en concordancia con la Ord. 16/03-CS. Por otra parte los alumnos cuentan con una guía de lectura actualizada; además de una guía de trabajos prácticos con referencia teórico-conceptual.

6. REGIMEN DE ENSEÑANZA Y EVALUACION

Las clases de Econometría II son de tipo teórico-prácticas, ilustradas con ejemplos adecuados que pueden integrar un taller de trabajo. Los alumnos resolverán los trabajos prácticos y la monografía (2do. Parcial) con el uso de la última versión del software E-VIEWS.

El régimen de evaluación consiste en dos exámenes parciales y un examen final. La regularidad exige la aprobación de los dos exámenes y la asistencia del 75% de las clases teórico-prácticas.

Además se incluye un examen recuperatorio y un examen integrador, en los términos de la Ordenanza Nro.18/03-CD, artículos 6to. y 12do. respectivamente, monografía (2do. Parcial), y un examen final. Las calificaciones se adecuarán a las pautas fijadas en la Ord. 10/05-CD.

Para acceder al examen integrador, los alumnos deben presentar y tener aprobada la monografía.