

INSTITUTO DE DESARROLLO ECONÓMICO E INNOVACIÓN

Año: 2021



Universidad Nacional de Tierra del Fuego,
Antártida e Islas del Atlántico Sur.

PROGRAMA DE LA ASIGNATURA:
Econometría (ECO18)

CÓDIGO: ECO18
AÑO DE UBICACIÓN EN EL PLAN DE ESTUDIOS:
4 año
FECHA ULTIMA REVISIÓN DE LA ASIGNATURA:
2021-03-03
CARRERA/S: Licenciatura en Economía V6,

CARÁCTER: CUATRIMESTRAL (1ro)
TIPO: OBLIGATORIA
NIVEL: GRADO
MODALIDAD DEL DICTADO: PRESENCIAL (EN LÍNEA)
MODALIDAD PROMOCION DIRECTA: SI
CARGA HORARIA SEMANAL: 6 HS
CARGA HORARIA TOTAL: 102 HS

EQUIPO DOCENTE

Nombre y Apellido	Cargo	e-mail
Silvana Curcio	Profesora Adjunta	scurcio@untdf.edu.ar

1. FUNDAMENTACION

La materia Econometría se fundamenta para la Licenciatura en Economía en que provee al alumno del método cuantitativo científico para analizar, modelar comportamiento, validar, estimar y pronosticar comportamientos, relaciones y problemas de distintas áreas de la economía. Se articula con las materias que formaron a los alumnos en las disciplinas de análisis matemático, álgebra y estadística, al aplicar estos conocimientos directamente en una serie de métodos específicos a cada conjunto de datos, en la teoría y en la práctica. Prepara para las materias de análisis macroeconómico, crecimiento, y de tópicos de desarrollo económico e innovación, para interpretar teorías basadas en estudios econométricos, así como también a comenzar en la investigación.

2. OBJETIVOS

a) OBJETIVOS GENERALES

Este curso tiene como objetivo que los estudiantes comprendan que es un modelo econométrico, que tipos hay, y cómo resolverlos o cómo crearlos. Debe basarse en la teoría para su mejor aplicación. En la primera parte se estudian los modelos de regresión lineales para datos de corte transversal, los métodos de estimación de mínimos cuadrados y de máxima verosimilitud. En la segunda parte se estudian las variables dependiente limitada y variable independiente endógena. En la tercera parte se ven los modelos de series de tiempo y de datos de panel.

b) OBJETIVOS ESPECIFICOS

- Comprender la naturaleza de los datos, de las variables, modelos y métodos, alcances y limitaciones.
- Lograr entender cómo se deducen los modelos, los estimadores, las pruebas de hipótesis, los pronósticos.
- Adquirir la capacidad de modelar en regresión lineal, obtener resultados en el método de

mínimos cuadrados, configurar las bases de datos, utilizar apropiadamente el software especializado.

3. CONDICIONES DE REGULARIDAD Y APROBACION DE LA ASIGNATURA

Las clases son virtuales, en línea, de modo sincrónico, en contenidos teóricos y sesiones prácticas, más actividades asincrónicas como guía de preguntas, y tres trabajos prácticos. Los exámenes parciales y recuperatorios se toman en línea.

Las condiciones para regularizar la materia son la asistencia al 70% de clases en línea, la entrega de las actividades asincrónicas y la aprobación de dos exámenes parciales con un promedio de cuatro puntos. La materia tiene la opción de promoción si además de las condiciones de regularización, el promedio de los parciales es de siete puntos.

4. CONTENIDOS DE LA ASIGNATURA

Unidad I: Modelo Lineal para datos de corte transversal y regresores no estocásticos
Introducción.

Tipología de datos, variables aleatorias, y modelos econométricos.

Modelo Lineal de Regresión Simple de regresores no estocásticos y variables cuantitativas.

Supuestos de Gauss-Markov.

Métodos de estimación del modelo lineal. El método de Mínimos Cuadrados Clásicos u ordinarios.

Requisitos. Propiedades de los estimadores. Teorema de Gauss-Markov.

Inferencia. Predicción.

Modelo de regresión lineal múltiple. Efectos parciales.

Modelos con restricciones en los coeficientes.

Teoría asintótica

Modos de convergencia en probabilidad y en distribución. Desigualdad de Markov y desigualdad de Tchebychev. Ley de grandes números. Teorema Central del Límite. Teorema de la función continua. Teorema de Slutsky. Método Delta.

Unidad II: Incumplimiento de los supuestos en el Modelo de Regresión Lineal

No linealidad. Linealización de modelos no lineales. Interpretación de los coeficientes de regresión.

Datos anómalos. Análisis de los residuos.

Errores de especificación en los modelos. Sesgo de variables omitidas, de inclusión de variables irrelevantes.

Problemas con los supuestos del modelo: Multicolinealidad, Heterocedasticidad, Autocorrelación.

Contraste de Heteroscedasticidad. Efecto de la Heteroscedasticidad en los Estimadores OLS. El método de Mínimos Cuadrados Generalizados.

Unidad III: Variable cualitativa o dummy, variable dependiente limitada, y variables explicativas endógenas.

Modelos de regresión lineal con regresores no estocásticos y variables cualitativas. Variable explicativa dicotómica o categórica.

Modelos de regresión lineal con variable dependiente cualitativa. Dicotoma: Modelos: Lineal de probabilidad, Logit, Probit, Tobit (Modelo de regresión con variable dependiente limitada o datos censurados)

Modelos de regresión lineal con regresores estocásticos. Endogeneidad.

Variables omitidas. Error de medición.

Modelo de ecuaciones simultáneas. Simultaneidad.

Método de Mínimos cuadrados con variables instrumentales.

Método de mínimos cuadrados en dos etapas.

Unidad IV: Modelo lineal para datos de series de tiempo

Modelos de regresión lineal con variable dependiente rezagada como regresor no estocástico.
Modelos Medias Móviles, ARMA, ARIMA y VAR (multivariante). Predicción.
Series de tiempo no estacionarias. Test de estacionariedad.
Cointegración.
Modelo de corrección del error.
Modelo lineal para datos de series de tiempo con regresores estocásticos
Modelos lineales dinámicos, de rezagos distribuidos con la variable dependiente estocástica.
Autorregresivos, recursivos.
Modelos de ecuaciones simultáneas para series de tiempo.

Unidad V Modelos para datos de panel
Estimación de efectos fijos.
Modelos de efectos aleatorios.

5. RECURSOS NECESARIOS

- Polycom
- Proyector
- Parlantes
- Pc
- Laboratorio Informatica
- Moodle

6. PROGRAMACIÓN SEMANAL

Semana	Unidad / Módulo	Descripción	Bibliografía
1	1	Usos de la Econometría, Conceptos básicos de estadística y matemática	Woolridge, Cap. 1 y apendices
2	1	Modelo Clásico de Regresión Lineal Simple	Woolridge, Cap. 2
3	1	Modelo Clásico de Regresión Lineal Múltiple	Woolridge, Cap. 3
4	1	Modelo Clásico de Regresión Lineal Múltiple: Pruebas de hipótesis	Woolridge, Cap. 4
5	2	Problemas de estimación e inferencia	Woolridge, Cap. 5 y 6
6	2	Incumplimientos de los supuestos de Gauss Markov y Correcciones	Woolridge, Cap. 8 y 9
7	1 y 2	Revisión y Exámen	
8	3	Variables explicativas cualitativas	Woolridge, Cap. 7
9	3	Variables dependientes limitadas	Woolridge, Cap. 17
10	3	Variables explicativas endógenas	Woolridge, Cap. 15
11	4	Series de tiempo	Woolridge, Cap. 10 y 11
12	4	Series de tiempo: estacionariedad y cointegración	Woolridge, Cap. 12 y 18
13	5	Datos de panel	Woolridge, Cap. 13
14	5	Datos de panel	Woolridge, Cap. 14
15	3, 4 y 5	Revisión y Examen	
16	1 a 5	Recuperatorio e integración	

7. BIBLIOGRAFIA DE LA ASIGNATURA

Autor	Año	Título	Capítulo/s	Lugar de la Edición	Editor / Sitio Web
Jeffrey Wooldridge	2002	Introducción a la Econometría	1 a 19		Pearson
James Stock y Mark Watson	2012	Introducción a la Econometría			
Damodar Gujarati y Dawn Porter	2010	Econometría			McGrawHill

Firma del docente-investigador responsable

VISADO		
COORDINADOR DE LA CARRERA	DIRECTOR DEL INSTITUTO	SECRETARIO ACADEMICO UNTDF
Fecha :	Fecha :	