



Universidad Nacional de Salta



Facultad de Ciencias Económicas,
Jurídicas y Sociales

RES. DECECO N° 012.15

Salta, 02 FEB 2015
EXPEDIENTE N° 6.818/05

VISTO: La nota presentada por el Lic. **Gastón J. Carrazán Mena**, Profesor Adjunto interino de la asignatura **ECONOMETRIA II**, mediante la cual eleva la planificación de dicha materia para la carrera de Licenciatura en Economía, Plan de Estudios 2003, período lectivo 2.015, y;

CONSIDERANDO:

Lo dictaminado por la comisión de Docencia, a fs. 63 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 N° 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 de las atribuciones que le son propias,

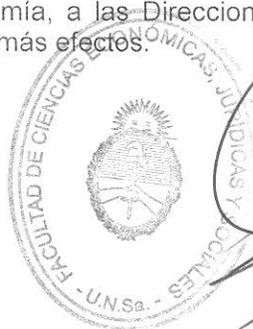
**EL VICEDECANO DE LA FACULTAD DE CIENCIAS ECONOMICAS
JURIDICAS Y SOCIALES
RESUELVE:**

ARTICULO 1°.- APROBAR la planificación que obra de fs. 53 a 61, de la asignatura **ECONOMETRIA II**, de la carrera de Licenciatura en Economía, Plan de Estudios 2003, presentada por el Lic. **Gastón J. Carrazán Mena**, Profesor Adjunto interino de la citada asignatura, para el período académico 2.015, 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. **Gastón J. Carrazán Mena**, al Lic. **Carlos Luis Rojas**, Director del Dpto. de Economía, a las Direcciones de Alumnos e Informática y al CEUCE, para su toma de razón y demás efectos.

ah

H. Sánchez de Maza
Cristina Sánchez de Maza
Secretaría Académica y de Investigación
Fac. de Econ. Jur. y Soc. - UNSa.



Hugo Ignacio Llinos
Hugo Ignacio Llinos
VICE DECANO
Fac. Cs. Econ. Jur. y Soc. - UNSa



ANEXO I - Res. DECECO N° 012.15

ECONOMETRIA II

CARRERA: Licenciatura en Economía
PLAN DE ESTUDIOS: 2003
PERIODO LECTIVO: 2015

AÑO DE LA CARRERA: 4º
REGIMEN: Cuatrimestral
CARGA HORARIA SEMANAL: 6 horas

EQUIPO DOCENTE

DOCENTE	CATEGORÍA	DEDICACIÓN
Gastón J. Carrazán Mena	Profesor Adjunto interino	Simple

IMPORTANCIA E INTEGRACIÓN EN EL PLAN DE ESTUDIOS

La Econometría es una conjunción de Matemática, Estadística y Teoría Económica. El alumno de 4to año de la licenciatura en Economía tiene hasta este momento un bagaje teórico en áreas del campo de la economía, que en conjunto con las herramientas de la econometría, le permitirán contrastar teorías y proponer modelos.

Así, el curso está orientado a que el alumno aprehenda herramientas que le servirán en el análisis microeconómico y macroeconómico. Ellos, podrán ser aplicados en esta materia, y en materias que se desarrollan en conjunto o de manera posterior a Econometría II.

OBJETIVOS

GENERAL

Que los alumnos puedan afianzar y enriquecer sus conocimientos en Microeconometría y Macroeconometría despertando en ellos inquietudes en cuanto a la aplicación de los contenidos aprendidos.

ESPECÍFICOS

- 1) Introducir al alumno en el conocimiento de los métodos econométricos, que le permitirán aportar evidencias empíricas a las teorías que empleará en su vida académica y profesional.
- 2) Entrenarlo en el uso de esos métodos, poniéndolo en contacto con datos que suelen emplearse y con software estadísticos-económicos, como una primera aproximación a la Econometría Aplicada.
- 3) Enseñarle a plantear un problema profesional o de investigación mediante la secuencia: Teoría – búsqueda de datos – replanteo de la teoría (para adecuarla a los datos posibles) – estimación – conclusiones.





PROGRAMA DE CONTENIDOS (ANALÍTICO Y DE EXAMEN)

Módulo I: Microeconometría de Datos de Corte Transversal

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 para datos multinomiales y ordinales– Modelos de duración y modelos de recuento– Censura y Truncamiento.

Módulo II: Macroeconometría de Datos en Series de Tiempo

Tema III: Modelos de Series Temporales Estacionarias

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

Tema IV: 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 V: 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 VI: Volatilidad Variable en el Tiempo y Modelos ARCH

Introducción – Volatilidad variable en el tiempo – Modelos ARCH y GARCH – Estimación y pruebas de diagnóstico – Pronóstico de volatilidad.

Módulo III: Microeconometría de Panel de Datos

Tema VII: Combinación de Datos de Sección Cruzada (Pooled) en el tiempo

Introducción – Combinación de Cortes Transversales independientes en el tiempo - Organización de los datos en un Panel – Análisis de políticas y evaluación de programas.

Tema VIII: Métodos de Panel de Datos

Introducción - 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.

METODOLOGÍA

La enseñanza será impartida mediante los siguientes procedimientos: i) Clases teóricas interactivas; ii) Clases prácticas y de aplicación; iii) Diálogo entre profesor- alumnos que permita un intercambio de ideas, opiniones e inquietudes.

Aproximadamente se empleará el sesenta por ciento del tiempo de clases disponibles en i), un veinticinco por ciento en ii) y un quince por ciento en iii).





CRITERIOS Y SISTEMA DE EVALUACIÓN

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 calificación será de 1 a 10. Un examen parcial tendrá lugar a mediados de cuatrimestre y el otro al final del mismo. El trabajo de aplicación 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

REGULARIDAD: Quienes en los dos exámenes parciales y en el trabajo de investigación aplicada, obtuvieran, al menos, 4 (cuatro) puntos, en cada uno de ellos, estarán en condiciones de regularizar la materia. Asimismo, el alumno podrá recuperar uno de los exámenes parciales, en el que hubiera sido aplazado o hubiere estado ausente, en tanto y en cuanto apruebe primero el otro examen parcial. 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. También, si fuera necesario, el alumno podrá rehacer el trabajo de investigación aplicada, en cuyo caso el mismo deberá entregarse al momento que se tome el examen de recuperación.

PROMOCIÓN: Quienes en los dos exámenes parciales y en el trabajo de investigación aplicada hayan obtenido como mínimo 7 (siete) puntos, en cada uno de ellos, habrán promovido la asignatura, sin examen final. Les corresponderá como nota, el promedio obtenido entre las notas de los dos exámenes parciales y del trabajo de investigación aplicada, convenientemente redondeado.

RECURSOS A UTILIZAR

Recursos humanos: 1 (un) docente.

Recursos físicos: La bibliografía detallada. Un aula acorde con el número de alumnos. Los servicios de una computadora y un proyector multimedia. Gabinete de computación para el dictado de las clases prácticas.

Es una limitación importante la existencia de material bibliográfico en lugares de acceso público (biblioteca). Por tal motivo en algunos casos se deberá trabajar con material fotocopiado o digital.

Material Didáctico: Plataforma Moodle de la materia. Bases de Datos on-line.

ORGANIZACIÓN DEL DICTADO DE CLASES

Nº Comisión	Teórica/Práctica	Responsable	Horas Semanales
Única	Teórica	Carrazón Mena, Gastón J.	4
Única	Práctica	Carrazón Mena, Gastón J.	2

BIBLIOGRAFÍA

BIBLIOGRAFÍA BÁSICA			
AUTOR	TÍTULO	EDITORIAL	Lugar y año de edición
Cabrer Borrás, B.; Sancho, A.; Serrano Domingo, G.	Microeconomía y Decisión	Ediciones Pirámide, S.A	Madrid, 2001.
Enders, Walter	Applied Econometric Time Series	John Wiley & Sons Inc.	Hoboken, New Jersey, 2010
Heij, C., de Boer, P., Franses, P. H., Kloek, T. y van Dijk, H.	Econometric Methods with Application in Business and Economics	Oxford	New York, 2004
Hill, R. C., Griffiths, W. E. y Lim, G. C.	Principles of Econometrics	John Wiley & Sons Inc.	Hoboken, New Jersey, 2011
Kirchgässner, G. y Wolters, J.	Introduction to Modern	Springer	Verlag, Berlin, 2013





	Time Series Analysis		
Wooldridge, Jeffrey M.	Introducción a la Econometría. Un enfoque moderno	Thomson Learning	México, 2010
BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA			
AUTOR	TÍTULO	EDITORIAL	Lugar y año de edición
Baltagi, Badi H.	Econometrics 5 th edition	Springer	New York, 2011.
Berndt, Ernst R.	The practice of econometrics: classic and contemporary	Addison Wesley Publishing.	MA, USA, 1991
Diebold, Francis	Elementos de Pronósticos	International Thomson Editores	México, 1999
Greene, William	Econometric Analysis	Prentice Hall	New Jersey, 2008
Johnston, J. y DiNardo, J.	Econometric Methods	The McGraw Hill Companies	New York, 1997
Novales Cinca, Alfonso	Econometría	McGraw Hill	Madrid, 2002
Patterson, Kerry	An Introduction to Applied Econometrics: a time series approach	St. Martin's Press	USA, 2000
Wooldridge, Jeffrey M.	Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data – 2 nd edition	MIT Press	Cambridge, 2002

CRONOGRAMA DE CLASES Y EVALUACIONES

Clase N°	Hs	T/P	Actividad – Tema	Responsable
1	2	T	Tema I: Modelos No Lineales	Carrazán Mena
2	2	T	Tema I: Modelos No Lineales	Carrazán Mena
3	2	P	TP01: Repaso Estadístico y Software	Carrazán Mena
4	2	T	Tema II: Modelos de Variables Dependientes Cualitativas y Limitadas	Carrazán Mena
5	2	T	Tema II: Modelos de Variables Dependientes Cualitativas y Limitadas	Carrazán Mena
6	2	P	TP02: Modelos No Lineales	Carrazán Mena
7	2	T	Tema II: Modelos de Variables Dependientes Cualitativas y Limitadas	Carrazán Mena
8	2	T	Tema II: Modelos de Variables Dependientes Cualitativas y Limitadas	Carrazán Mena
9	2	P	TP03: Modelos de Variables Dependientes Cualitativas y Limitadas	Carrazán Mena
10	2	T	Tema III: Modelos de Series Temporales Estacionarias	Carrazán Mena
11	2	T	Tema III: Modelos de Series Temporales Estacionarias	Carrazán Mena
12	2	P	TP04: Modelos de Series Temporales Estacionarias-1era parte	Carrazán Mena
13	2	T	Tema III: Modelos de Series Temporales Estacionarias	Carrazán Mena
14	2	T	Tema III: Modelos de Series Temporales Estacionarias	Carrazán Mena
15	2	P	TP05: Modelos de Series Temporales Estacionarias-continuación	Carrazán Mena
16	2	T	Tema IV: Modelos de Series Temporales No Estacionarias	Carrazán Mena





17	2	T	Tema IV: Modelos de Series Temporales No Estacionarias	Carrazán Mena
18	2	P	TP06: Modelos de Series Temporales No Estacionarias-1era parte	Carrazán Mena
19	2	T	Tema IV: Modelos de Series Temporales No Estacionarias	Carrazán Mena
20	2	T	Tema IV: Modelos de Series Temporales No Estacionarias	Carrazán Mena
21	2	P	TP 07: Modelos de Series Temporales No Estacionarias-continuación	Carrazán Mena
22	2	T/P	Primer Examen Parcial – Temas I a IV	Carrazán Mena
23	2	T	Tema V: Regresión con Variables No Estacionarias	Carrazán Mena
24	2	T	Tema V: Regresión con Variables No Estacionarias	Carrazán Mena
25	2	P	TP08: Regresión con Variables No Estacionarias-1era parte	Carrazán Mena
26	2	T	Tema V: Regresión con Variables No Estacionarias	Carrazán Mena
27	2	T	Tema V: Regresión con Variables No Estacionarias	Carrazán Mena
28	2	P	TP08: Regresión con Variables No Estacionarias-continuación	Carrazán Mena
29	2	T	Tema VI: Volatilidad Variable en el Tiempo y Modelos ARCH	Carrazán Mena
30	2	T	Tema VI: Volatilidad Variable en el Tiempo y Modelos ARCH	Carrazán Mena
31	2	P	TP09: Volatilidad Variable en el Tiempo y Modelos ARCH-introducción	Carrazán Mena
32	2	T	Tema VI: Volatilidad Variable en el Tiempo y Modelos ARCH	Carrazán Mena
33	2	T	Tema VI: Volatilidad Variable en el Tiempo y Modelos ARCH	Carrazán Mena
34	2	P	T.P.10: Volatilidad Variable en el Tiempo y Modelos ARCH	Carrazán Mena
35	2	T	Tema VII: Combinación de Datos de Sección Cruzada (Pooled) en el tiempo	Carrazán Mena
36	2	T	Tema VII: Combinación de Datos de Sección Cruzada (Pooled) en el tiempo	Carrazán Mena
37	2	P	T.P.11: Combinación de Datos de Sección Cruzada (Pooled) en el tiempo	Carrazán Mena
38	2	T	Tema VIII: Métodos de Panel de Datos	Carrazán Mena
39	2	T	Tema VIII: Métodos de Panel de Datos	Carrazán Mena
40	2	P	TP12: Métodos de Panel de Datos-introducción	Carrazán Mena
41	2	T	Tema VIII: Métodos de Panel de Datos	Carrazán Mena
42	2	T	Tema VIII: Métodos de Panel de Datos	Carrazán Mena
43	2	P	TP13: Tema VIII: Métodos de Panel de Datos-continuación	Carrazán Mena
44	2	T/P	Segundo Examen Parcial – Temas V a VIII y Entrega de Trabajo Final	Carrazán Mena
45	2	T/P	Exámenes Recuperatorios	Carrazán Mena





CLASES DE CONSULTA

Día Semana	Horario	Periodicidad	Lugar	Responsable/s
Jueves	10 a 12	Semanal	Box 103	G. Carrazán Mena

REUNIONES DE CATEDRA

Día Semana	Horario	Periodicidad	Lugar
Viernes	14 a 16	Quincenal	Box 105

ACTIVIDADES DE CAPACITACIÓN Y PERFECCIONAMIENTO DOCENTE

Curso	Docente/s	Lugar y fecha
Especialización en Docencia Universitaria	Equipo docente del Departamento de Posgrado de la Facultad de Ciencias de la Salud – UNSA	Facultad de Ciencias de la Salud – UNSa. Marzo a Diciembre de 2015.

PARTICIPACIÓN EN REUNIONES CIENTÍFICAS

Reuniones científicas	Lugar y fecha
L Reunión anual de la Asociación Argentina de Economía Política (AAEP)	Ciudad de Salta, Salta. Noviembre 2015.
Reunión anual de la Sociedad Argentina de Economía Regional (SAER)	Universidad Nacional de Tucumán, San Miguel de Tucumán. Mayo 2015.
Jornada Anual de la Sociedad Argentina de Estadística (SAE)	Lugar a definir. Octubre 2015.
XIII jornada de ARESNOA (Asociación Regional de Economía y Sociedad del NOA)	Universidad Nacional de Jujuy, San Salvador de Jujuy. Agosto 2015.

ACTIVIDADES DE EXTENSIÓN Y/O SEMINARIOS

Tipo de Actividad	Responsables	Fecha y lugar de ejecución
Seminario en Series de Tiempo utilizando E-Views	Gastón J. Carrazán Mena	1er cuatrimestre 2015, Facultad de Ciencias Económicas - Universidad Nacional de Santiago del Estero.

DISTRIBUCIÓN HORARIA SEMANAL ESTIMADA DEL EQUIPO DOCENTE:

Docente	Docencia	Investigación	Gestión	Extensión
G. Carrazán	10	15	5	5

OTRAS ACTIVIDADES

Presentación y posterior defensa oral de Tesis de Maestría. Carrera: Magister en Estadística Aplicada, Instituto de Investigaciones Estadísticas de la Universidad Nacional de Tucumán. 1er cuatrimestre 2015.
Miembro del comité organizador local de la 50 reunión anual de la Asociación Argentina de





Economía Política, a realizarse en el mes de Noviembre 2015 en el ámbito de la Facultad de Ciencias Económicas, Jurídicas y Sociales de la UNSa.
Dictado de la asignatura Econometría I y Teoría Monetaria. 2do Cuatrimestre 2015.

OBSERVACIONES:

El Seminario se encuentra sujeto a confirmación por parte de la Universidad Nacional de Santiago del Estero, como así también a la cantidad de inscriptos que se registre en el mismo.

ACTIVIDADES DE INVESTIGACIÓN:

Titulo	Propósito/Objetivos	Evaluación/Avance	Equipo de trabajo
Construcción de un Indicador sintético de actividad económica para la provincia de Salta.	Construir un Indicador de la actividad económica provincial, que adelante o siga los movimientos del Producto Bruto Geográfico (PBG) de Salta, pero con una frecuencia mayor.		Eugenio Martinez (Asesor), Gastón Carrazán (Director), Daniel Sánchez, Luis Mauri, Pablo Pagani, Federico Flores Herrera, Martín Daroca Aparicio, Mariana Zannier.
La Independencia y Gobernanza del Banco Central de la República Argentina desde sus inicios: un análisis retrospectivo	Construir un índice dinámico mixto tanto <i>de jure</i> como <i>de facto</i> de la independencia y gobernanza del BCRA desde 1935 hasta la actualidad y ver su relación con la inflación y las crisis económicas Argentinas.	Proyecto Tipo A del CIUNSa N° 2158. Años de ejecución 2014 a 2017. Alta de Proyecto: abril de 2014	Director: Eugenio Martínez. Investigadores: Gaston Carrazan, Daniel Sanchez Fernandez, Cecilia Dip, Cecilia Amiri, Martin Daroca A, Fernando Romero, Carla Wierna. Alumno Adscripto: Luis Kabbas
Contribución Económica del Turismo en la Provincia de Salta	Medir el aporte de la actividad del Turismo a las cuentas del Producto Bruto Geográfico (PBG) provincial, utilizando un método de barrido transversal sobre el PBG.	Proyecto interno N° 7 del Instituto de Investigaciones Económicas (IIE). En 2014 se realizaron 2 estimaciones, replicando la metodología predominante. Además, se logró una adaptación a partir de la estructura productiva del PBG de Salta. En 2015, se pretende avanzar sobre la creación de coeficientes regionales, para realizar un último cómputo.	Integrantes: Luis Mauri, Gastón Carrazán Mena, Daniel Sánchez Fernández



Salta, Febrero de 2015

[Handwritten signature]

Lic. Gastón J. Carrazán Mena