



Universidad Nacional de Salta



Facultad de Ciencias Económicas,
Jurídicas y Sociales

"Las Malvinas son argentinas"

"50 Aniversario de la UNSa. Mi sabiduría viene de esta tierra"

Salta, 10 de Noviembre de 2022

RESOLUCIÓN DECECO N° 1051/22

EXPEDIENTE N° 6451/22

VISTO: Las presentes actuaciones mediante las cuales se tramita la aprobación, para el Período Lectivo 2022, de los contenidos programáticos de la asignatura **Econometría II**, de la Carrera Licenciatura en Economía, Plan de Estudios 2003, de Sede Salta, presentados por el Dr. Marcos HERRERA GOMEZ, Profesora Regular Adjunto de la mencionada asignatura, y;

CONSIDERANDO:

Que por Resolución CD-ECO N° 295/18 se establece la modalidad de presentación de las planificaciones de las diferentes cátedras que componen los planes de estudios dependientes de esta Unidad Académica.

Que la propuesta presentada cumple con las normativas vigentes de aplicación –Resolución CS N° 320/03.

Que a fs. 85 del Expediente de referencia, obra informe de la Dirección del Departamento de Economía donde aconseja la aprobación de los contenidos programáticos de la asignatura "Econometría II" –Carrera Licenciatura en Economía –Sede Salta –Ciclo Lectivo 2022.

Que a fs. 9 del Expediente de referencia, obra Despacho N° 386/22, de la Comisión de Docencia, Investigación y Disciplina donde aconseja la aprobación, para el ciclo lectivo 2022, de los contenidos programáticos de la asignatura "Econometría II" –Carrera Licenciatura en Economía – Sede Salta.

Que el Art. 113, inc. 8 de la Resolución A. U. N° 01/96 –Estatuto de la Universidad Nacional de Salta establece como una atribución del Consejo Directivo la de aprobar programas analíticos y la reglamentación sobre régimen de regularidad y promoción.

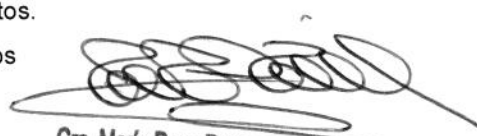
Que mediante las Resoluciones N° 420/00 y 718/02, el Consejo Directivo de esta Unidad Académica, delega al Señor Decano las atribuciones antes mencionadas.

POR ELLO: en uso de las atribuciones que le son propias,
**EL DECANO DE LA FACULTAD DE CIENCIAS ECONOMICAS,
JURÍDICAS Y SOCIALES
RESUELVE:**


ARTICULO 1°.- TENER POR APROBADOS para el Período Lectivo 2022, los contenidos programáticos, que obran de fs. 2 a 5 del Expediente de referencia, de la asignatura **Econometría II**, de la Carrera Licenciatura en Economía, Plan de Estudios 2003, de Sede Salta, presentados por el Dr. Marcos HERRERA GOMEZ, Profesora Regular Adjunto de la mencionada asignatura, y que obran como Anexo I, de la presente resolución.

ARTICULO 2°.- HÁGASE SABER al Departamento de Economía, al Profesor Marcos HERRERA GOMEZ, a las Direcciones de Alumnos e Informática y al C.E.U.C.E., para su toma de razón y demás efectos.

ahl/os


Cra. María Rosa Panza de Miller
Secretaría de As. Académicos
Fac. Ca. Econ. Jur. y Soc.- UNSa




Mg. ANGÉLICA ELVIRA ASTORGA
VICE DECANA
Fac. de Cs. Econ. Jur. y Soc.- UNSa



"Las Malvinas son argentinas"

"50 Aniversario de la UNSa. Mi sabiduría viene de esta tierra"

ANEXO I – RESOLUCIÓN DECECO Nº 1051-22
CONTENIDOS PROGRAMÁTICOS

ASIGNATURA:	ECONOMETRÍA II		
DEPARTAMENTO DOCENTE:	Economía		
CARRERA (S):	Licenciatura en Economía		
SEDE:	Salta		
AÑO DE LA CARRERA:	4to. Año		
CUATRIMESTRE:	Primero		
PLAN DE ESTUDIOS:	2003		
CARGA HORARIA TOTAL:	78 Horas	SEMANAL:	6 Horas
PERÍODO LECTIVO:	2022		

EQUIPO DOCENTE:

DOCENTE	GRADO ACADEMICO MAXIMO	CATEGORÍA	DEDICACIÓN
Marcos Herrera Gómez	Dr. en Economía	Profesor Adjunto Regular	Simple
Federico Flores Herrera	Lic. en Economía	Auxiliar de Primera	Semi-exclusiva

INTEGRACIÓN DE LA ASIGNATURA EN EL PLAN DE ESTUDIOS

La materia se ubica en el cuarto año de la carrera de Licenciatura en Economía. Se nutre principalmente de los aportes de Econometría I, así como de los conceptos vistos en Estadística II. El programa contempla los requisitos mínimos del Plan de Estudio 2003: Modelos No Lineales - Algoritmos Numéricos de estimación (en Tema 1), Modelos de Series Temporales (en Tema 3), Regresión con Variables no Estacionarias (en Tema 4) y Datos de Panel (en Tema 5). Adicionalmente, se propone el tratamiento de variable dependiente no-continua (Tema 2), que utiliza las técnicas de estimación del Tema 1 y busca cubrir los fundamentos metodológicos de los modelos utilizados en materias como Economía Laboral, Desarrollo Económico, entre otras. Los temas del curso de Econometría II están pensados de forma integral para que sirvan como herramienta técnica de otras materias afines como en el análisis de los problemas de desarrollo económico, economía laboral, finanzas públicas, economía internacional, entre otras.

OBJETIVOS

El objetivo general del curso es proporcionar al alumno herramientas econométricas necesarias para interpretar y realizar estudios empíricos, así como fortalecer el uso métodos estadísticos según el tipo de información disponible.

Entre los objetivos específicos, se pretende que los alumnos:

- Conozcan las técnicas de estimación frecuentemente utilizadas en econometría como máxima verosimilitud y método de momentos generalizados.
- Adquieran familiaridad en la aplicación de modelos según el problema empírico y la estructura de los datos.
- Identifiquen las principales debilidades y fortalezas de cada método de estimación mejorando su capacidad crítica y analítica.
- Interpreten los resultados inferenciales adecuadamente, haciendo más eficiente la labor de investigación económica.





PROGRAMA DE CONTENIDOS (ANALÍTICO Y DE EXAMEN)

Tema 1: Modelos no lineales

Introducción a Modelos no-lineales – Elementos de teoría asintótica – Mínimos Cuadrados no lineales – Estimación por Máxima Verosimilitud – Método de Momentos Generalizados – Diferentes algoritmos de optimización numérica.

Tema 2: Modelos de variable dependiente no-continua

Introducción: Modelos Logit y Probit – Modelos de regresión censurada y truncada – Selección muestral – Aplicaciones económicas.

Tema 3: Modelos Univariantes de Series Temporales

(1) Aspectos introductorios a regresores estocásticos – Justificación y concepto de procesos estocásticos lineales discretos (MA, AR, ARMA, ARIMA) – Análisis de estacionariedad – Contrastes de raíces unitarias. (2) Metodología Box-Jenkins – Identificación de procesos subyacentes: Función de autocovarianza, autocorrelación y autocorrelación parcial – Estimación y chequeo: análisis residual, análisis de coeficientes – Predicción.

Tema 4: Modelos de Regresión Multivariantes en Series Temporales

(1) Introducción a regresiones con variables no-estacionarias: Regresiones espurias – Cointegración – Mecanismo de Corrección de Error. (2) Introducción a modelos de ecuaciones múltiples: Vectores Autoregresivos (VAR) – Causalidad de Granger – Funciones Impulso-Respuesta – Modelos de Vectores de Corrección de Error (VEC).

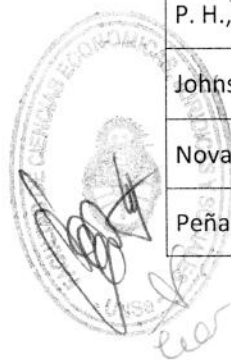
Tema 5: Modelos para Datos de Panel

(1) Combinación de cortes transversales en el tiempo – Modelos one-way y two-way – Estimación en primeras diferencias, de efectos fijos y de efectos aleatorios – Test de Hausman. (2) Modelos de paneles dinámicos – Raíces unitarias y cointegración en paneles – Modelos de paneles heterogéneos – Causalidad de Granger en paneles.

BIBLIOGRAFÍA:

BIBLIOGRAFÍA BÁSICA

AUTOR	TITULO	EDITORIAL	Lugar y año de edición
Carter Hill, R., Griffiths, W. y M. Lim.	Principles of Econometrics	Wiley & Sons	USA; 4 th Edition, 2011.
Heij, C., de Boer, P., Franses, P. H., Kloek, T. y H. van Dijk	Econometric methods with applications in business and economics.	Oxford University Press.	Oxford, 1 st Edition, 2004.
Johnston, J. y J. DiNardo	Econometric methods	McGraw-Hill Education	New York, 4 th Edition, 1997.
Novales, A.	Econometría	McGraw-Hill	España, 2 ^{da} edición, 2002
Peña, D.	Análisis de series temporales.	Alianza Editorial	España, 1 ^{ra} edición, 2005





Universidad Nacional de Salta



Facultad de Ciencias Económicas,
Jurídicas y Sociales

1051-22

"Las Malvinas son argentinas"

"50 Aniversario de la UNSa. Mi sabiduría viene de esta tierra"

OTRAS PUBLICACIONES
Se utilizarán notas de clase que contienen la temática completa y servirán de guía principal. Estas notas se basan en los textos de referencia mencionados en la Bibliografía (Básica y Complementaria) la cual deberá ser consultada para ampliar el contenido. Por su parte se proveerá de papers específicos según se avance en el temario. Además, se proveerá de una Guía de Ejercicios Prácticos.

BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA			
AUTOR	TÍTULO	EDITORIAL	Lugar y año de edición
Cameron, A. y P. Trivedi	Microeconometrics: Methods and Applications	Cambridge University Press.	UK; 1 st Edition, 2005
Enders, W.	Applied econometric time series	Wiley	USA, 4 th Edition, 2014
Greene, W.	Econometric Analysis	Pearson Education	NJ, 7 th Edition, 2003
Maddala, G. S.	Introduction to Econometrics	MacMillan Publishing Company.	New York, 2 nd Edition, 1992
Stock, J. y M. Watson	Introduction to econometrics	Pearson Series in Economics	USA, 4 th Edition, 2019
Wooldridge, J. M.	Econometric analysis of cross section and panel data.	MIT press	USA, 2 nd Edition, 2010

ESTRATEGIAS Y MODALIDADES DE ENSEÑANZA

(Marcar con una x las utilizadas)

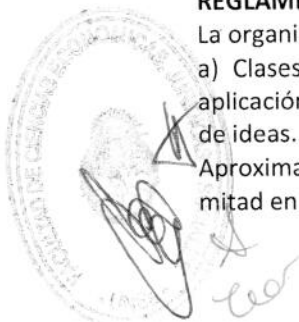
Clases expositivas	X	Análisis de textos	X
Aula Taller	X	Problematización	
Trabajo Individual	X	Resolución de ejercicios	X
Trabajo en grupos de pares	X	Resolución de situaciones problemáticas	
Exposición oral de alumnos		Estudio de casos	X
Debates		Análisis de incidentes críticos	
Diseño y ejecución de proyectos		Ejercicios de simulación	X
Seminarios-Monografías		Prácticas en Instituciones	
Clases virtuales	X	Visitas guiadas	
Otras: especificar			

REGLAMENTO DE CÁTEDRA

La organización del área curricular es la siguiente:

a) Clases teóricas interactivas con ejemplos simulados y/o empíricos; b) Clases prácticas o de aplicación usando R u otro software libre; c) Exposición de los alumnos y discusión con intercambio de ideas.

Aproximadamente se empleará la mitad del tiempo de clases disponibles en: a), dos tercios de la otra mitad en b) y un tercio en c).





1051-22

"Las Malvinas son argentinas"

"50 Aniversario de la UNSa. Mi sabiduría viene de esta tierra"

Distribución de la carga horaria semanal

Nº Comisión	Teórica/Práctica	Responsable	Días Semanales	Horario (Hs. Sem.)
Única	Teórica	Herrera	Lunes	10-12hs (2hs)
Única	Práctica	Herrera/Flores	Martes	10-12hs (2hs)
Única	Teórica	Herreras	Miércoles	10-12hs (2hs)

Sistema de evaluación

Se prevén las actividades siguientes:

- Exámenes parciales: 2 (dos)
- Trabajos prácticos: 2 (dos) (mínimo)

De estas actividades surgirá una nota, la cual deberá ser igual o superior a 4 (cuatro) en cada parcial para regularizar la materia y de 7 (siete) o superior en cada parcial para promocionar. Para promocionar deberá cumplir con todas las actividades, siendo así el cumplimiento de cada actividad adicional un requisito excluyente. La nota es un promedio ponderado según los valores siguientes:

Actividad	Ponderación
Parcial – primero	0,40
Parcial – segundo	0,40
Prácticos – Aprobado el 75%	0,20

Requisitos para el cursado de la materia

Es requisito formal para el cursado de la materia tener regularizada Econometría I. Además, el alumno deberá revisar contenidos estadísticos específicos, muchos de ellos aprendidos en Estadística II, para ello se aconseja como un libro de consulta al nivel de Rice (1995): *Mathematical Statistics and Data Analysis*, 3rd ed.

Condiciones para obtener la regularidad y/o la promoción

Exámenes parciales

En la primera prueba parcial se evaluarán los temas 1 a 3; en la segunda los temas 4 y 5. Las evaluaciones parciales son escritas y se pregunta acerca de aspectos conceptuales y de aplicación (ejercicios). La nota en la escala del 0 al 10 es también ponderada de acuerdo a la importancia dada por la cátedra a los temas y a la complejidad de cada uno de ellos incluidos en el examen. Para la promoción se requiere una mínima de 7 (siete) en cada parcial, además de cumplir los requisitos mencionados en Criterios y Sistema de Evaluación.

Para obtener la regularidad, el alumno podrá recuperar uno de los exámenes parciales en el que hubiera sido aplazado o hubiere estado ausente. El examen de recuperación será tomado aproximadamente una semana después del último examen parcial.

Trabajos prácticos

Se desarrollarán al menos 2 ejercicios. Para que un práctico se considere "aceptado" deberá contener la solución de, al menos, el 80% de las consignas. Se calificará como "aceptado", "no aceptado", "rehacer". En este último caso se indicará la fecha y modalidad de la nueva entrega. Si la segunda versión no resulta satisfactoria, el práctico se considerará "no aceptado". Para que sume la ponderación correspondiente a esta actividad, el alumno deberá haber entregado al menos el 50% de los prácticos.



Universidad Nacional de Salta



Facultad de Ciencias Económicas,
Jurídicas y Sociales

1051-22

"Las Malvinas son argentinas"

"50 Aniversario de la UNSa. Mi sabiduría viene de esta tierra"

Examen final

De no haber obtenido la calificación necesaria para promocionar la materia, una vez regularizada el alumno podrá presentarse en el examen en calidad de alumno regular. El examen final será oral.

Si el alumno desea aprobar la materia sin cursar (condición libre), deberá presentar antes del final los trabajos prácticos y realizar un ejercicio práctico utilizando el software R u otro similar. Aprobada esta instancia estará en condiciones de ser evaluado de la forma descrita en el párrafo precedente.

PROCESOS Y SISTEMA DE EVALUACIÓN:

De la Enseñanza:

La enseñanza será evaluada mediante entrevistas, encuestas anónimas semi-abiertas y diálogos con los estudiantes.

Del Aprendizaje

Para conocer los aprendizajes logrados por los estudiantes se considerará:

1. Capacidad para relacionar, organizar e integrar conceptos técnicos.
2. Identificación de las principales debilidades y fortalezas de los métodos econométricos revisados.
3. Interpretación de los resultados inferenciales en diferentes aplicaciones empíricas.

Cra. María Rosa Panza de Miller
Secretaría de As. Académica
Fac. Cs. Econ. Jur. y Soc.- UNSa



Mg. ANGÉLICA ELVIRA ASTORGA
VICE DECANA
Fac. de Cs. Econ. Jur. y Soc.- UNSa