

ECONOMETRÍA II

Plan de Estudios VIII (Licenciatura en Economía) – 2025

1. DATOS GENERALES DE LA ASIGNATURA

Carga Horaria:

- Total: 96 horas
- Semanal: 6 horas
- Distribución teoría y práctica: 48 hs clases teóricas y 48 hs de clases prácticas.
- Ciclo del Plan de Estudios: Plan VIII: Ciclo Profesional
- Régimen de cursada: Semestral
- Carácter: Obligatorio
- Modalidad: Teórico-Práctica
- Asignaturas correlativas necesarias: Econometría I

2. OBJETIVOS

Estudiar temas avanzados de econometría incluyendo series de tiempo, datos en panel e inferencia causal.

3. CONTENIDOS

Contenidos Mínimos:

Econometría de series temporales. Estacionalidad. Ciclo y tendencia. Filtros.

Procesos estocásticos. Modelos dinámicos. Estacionariedad e integración. Modelos ARIMA.

Cointegración y modelo de corrección de errores. Modelos VAR y VEC. Causalidad de Granger. Funciones impulso-respuesta.

Modelos para datos en panel. Estimador de efectos fijos y de efectos aleatorios. Identificación de efectos causales. Experimentos aleatorios y cuasi-experimentos. Estimadores de diferencias en diferencias, variables instrumentales y regresiones discontinuas.

Programa Analítico:

- Revisión del modelo lineal general uniecuacional. Introducción a regresores estocásticos y a la teoría asintótica. Criterios de evaluación de modelos econométricos.
- Series de tiempo estacionarias. El concepto de estacionariedad. Introducción a modelos autorregresivos y de promedios móviles (ARMA). Función de autocovarianza, autocorrelación y autocorrelación parcial. Ecuaciones de Yule-Walker. Estimación e inferencia. Pronóstico y predicción.
- No estacionariedad en series de tiempo. Contrastes de raíces unitarias. El concepto de cointegración y los modelos de corrección al equilibrio. Modelos con tendencia y estacionalidad. Modelos de filtros.
- Tópicos de series de tiempo. Cambios estructurales. Modelos no lineales (modelos de umbrales y de regímenes). Introducción a modelos de volatilidad y heterocedastidad condicional autorregresiva (ARCH y GARCH).
- Introducción a la metodología de vectores autorregresivos (VAR). Modelo estructural y en forma reducida. Identificación de modelos estructurales. Causalidad en el sentido de

Granger. Funciones impulso respuesta. Cointegración en modelos multivariados de corrección de errores (VEC).

- Modelos de datos en panel. Muestra longitudinal y cortes transversales agrupados.
- Modelos de componentes de errores en una y dos direcciones. Efectos fijos, primeras diferencias y efectos aleatorios. Contraste de Hausman. Modelos anidados y clusters.
- Modelos de paneles dinámicos. Paneles heterogéneos.

4. METODOLOGÍA DE ENSEÑANZA

La enseñanza centrada en el alumno tendrá como base de desarrollo el aprendizaje, con la guía de los docentes. El aprendizaje es un proceso de construcción activo donde se procura que el alumno sepa buscar y utilizar la información disponible para generar conocimientos nuevos que le permitan resolver los problemas que plantea la realidad.

El aprendizaje obtenido debe estar basado en una fundamentación lógica, teórica y empírica, no en estrategias memorísticas. Este planteo supone una conjunción entre teoría y práctica, en la que ambas se van constituyendo en un movimiento permanente de retroalimentación.

Para ello y desde el primer día de clase, el alumno debería estar dispuesto a estudiar sistemáticamente los distintos puntos enunciados en el programa de la asignatura. El rol del profesor es ubicarlos en la bibliografía cuya lectura se recomienda y esclarecer puntos dudosos, promoviendo de esta forma la discusión y el intercambio de ideas, desarrollando sus capacidades que lo ayuden a ser eficaz, responsable, investigador y crítico, en un mundo de cambios rápidos como en el que vivimos.

Sería deseable que el alumno lea la bibliografía (obligatoria al menos) indicada con anterioridad al tratamiento en clase del tema, para poder así aprovechar mejor la exposición del profesor y estar en condiciones de participar activamente en la clase (a través de preguntas directas o el debate).

Los docentes podrán hacer periódicamente un seguimiento de la lectura, en lo posible avisando previamente al alumno, a efectos de verificar el cumplimiento de esta obligación y orientar sobre la mejora de la cursada.

5. DESCRIPCIÓN ANALÍTICA DE ACTIVIDADES TEÓRICAS

En virtud de los objetivos indicados y la metodología explicitada precedentemente, el profesor a cargo del curso incentivará la participación de los alumnos en los temas teórico-prácticos, en las clases durante las cuales desarrollará aspectos esenciales, requiriendo:

- una actuación activa del alumno;
- propiciando los trabajos en grupo;
- promoviendo las discusiones, ya sea que los estudios se realicen en forma individual o en grupo.

Se propicia la formación de grupos de trabajo entre cuatro a seis participantes. La formación de los grupos será a elección de los alumnos, recomendándoles como elemento a considerar, básicamente, los horarios disponibles y la afinidad entre los participantes, por cuanto la tarea fundamental de estos grupos será la discusión de temas y casos, dentro y fuera de los horarios de clase.

El grupo funcionará principalmente para:

- * resolver casos, problemas y ejercitaciones prácticas en general;
- * seleccionar bibliografía (fuentes); * investigar temas controvertidos.

Dentro del proceso de enseñanza-aprendizaje, los casos prácticos constituyen una herramienta para que los alumnos se capaciten en la resolución de situaciones que puedan presentarse en la realidad y por lo tanto en su futura práctica profesional. Para ello se propiciará el uso de herramientas informáticas, en particular software estadísticos y econométricos.

Los casos de estudio que se propongan, las situaciones que eventualmente surjan de cada clase pretenden cubrir aspectos de una gama de situaciones diferentes que la práctica ha de presentar, con la guía del docente. Es por ello que se propicia la presentación de trabajos prácticos por parte de esos grupos de trabajo, representando esta actividad un enriquecimiento importante al aprendizaje, ya que no se limita a la solución de ejercicios, sino que posibilita que el alumno participe en la elaboración y búsqueda de casos que le serán relevantes y significativos.

Entre otras actividades se desarrollarán:

- Análisis de datos de distintas fuentes. Interpretación y su relación con la teoría económica.
- Identificación de problemas reales donde sea necesario implementar los modelos de regresión vistos en el curso.

6. FORMAS DE EVALUACIÓN

La evaluación de la asignatura se ajustará a lo establecido en la Resolución 189/25, que aprueba el Régimen Académico y de Enseñanza Integral de la Facultad de Ciencias Económicas. En este marco, el proceso de evaluación será integral y continuo, e incluirá instancias de evaluación parcial y, según corresponda, modalidades de promoción o acreditación mediante examen final, conforme al régimen de cursos vigente. Los criterios, instrumentos y condiciones de evaluación respetarán los requisitos de asistencia, aprobación y acreditación previstos por la normativa, y serán comunicados oportunamente a los/as estudiantes al inicio del curso.

7. BIBLIOGRAFÍA

Básica

Enders, W. (1995) "Applied Econometric Time Series". John Wiley & Sons.

Johnston, J. y Di Nardo, J. (1997) "Econometric Methods". Mc Graw Hill, New York.

Pindyck, R. y Rubinfeld, D. (2000) "Econometric Models and Economic Forecasts".

McGraw Hill.

Stock, J. y Watson, J. (2012) "Introducción a la Econometría". Prentice-Hall, New York.

Wooldridge, J. (2009 y ediciones posteriores) "Introducción a la Econometría: Un Enfoque Moderno". Thompson, Buenos Aires.

Avanzada y de consulta

Angrist, J.D. y Pischke, J.-S. (2009), *Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion*, Princeton University Press.

Baltagi, B.H. (2013), *Econometric Analysis of Panel Data* (5th edn), John Wiley & Sons. Cameron, A. C. y Trivedi P. K. (2005). *Microeconometrics: Methods and Applications*, Cambridge University Press.

Greene W. (1993 y ediciones posteriores), *Econometric Analysis*, Macmillan .

Hamilton J. (1994 y ediciones posteriores), *Time Series Analysis*, Princeton Univ. Press.

Hsiao, C. (2003), *Analysis of Panel Data*, Cambridge University Press.

Pesaran, M.H. (2015), *Time Series and Panel Data Econometrics*, Oxford University Press.

Wooldridge, J. (2012) *Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data*, MIT Press: Cambridge.