



**UNIVERSIDAD DE BUENOS AIRES**  
Facultad de Ciencias Económicas

Departamento de Matemática

Asignatura: Econometría

Código: 551

***Plan "1997"***

Cátedra: Profesora Mirta L. GONZALEZ

Carrera: Lic. en Economía.

**Aprobado por Res. Cons. Directivo  
(F.C.E.)**

**Nro.: 1975/07**

En caso de contradicción entre las normas previstas en la publicación y las dictadas con carácter general por la Universidad o por la Facultad, prevalecerán éstas últimas.



**UNIVERSIDAD DE BUENOS AIRES  
FACULTAD DE CIENCIAS ECONOMICAS**

**DEPARTAMENTO DE MATEMATICA**

**ASIGNATURA: ECONOMETRIA**

**Código: 551**

**Cátedra 1ª: Prof. Mirta Lidia González**

**ENCUADRE GENERAL**

**a) Fundamentación**

El contenido de la asignatura ha sido diseñado teniendo en cuenta la necesidad de todo economista, de verificar empíricamente las diversas teorías económicas.

Para ello será indispensable dotar a los futuros economistas de la formación teórica que les permita adquirir las habilidades en la especificación y estimación de modelos econométricos.

De esta manera, dispondrán de herramientas para contrastar las diversas hipótesis con las observaciones de la realidad, a la vez que utilizarlas con fines de predicción.

**b) Ubicación de la asignatura en el currículum**

La econometría ha sido ubicada, en el ciclo profesional, segundo tramo de la carrera de Economía y como optativa dentro de la carrera de Actuario.

Son requisitos de esta asignatura, estadística II (cód 285) y matemática para economistas (cód. 288).

Además de los requisitos formales mencionados esta asignatura requiere una sólida formación en micro y macroeconomía, de forma tal de asegurar su máximo aprovechamiento.

**c) Objetivos**

Son objetivos de esta asignatura:

- i) Impartir un sólida preparación en el área de la formulación y estimación de modelos econométricos.

- iii) Permitir el análisis de sensibilidad y estabilidad de los modelos frente a perturbaciones no previstas, y o cambios en los instrumentos de política económica.

d) Contenidos mínimos

- ✓ Modelo Lineal General
- ✓ Modelo Generalizado
- ✓ Modelos para Series de Tiempo
- ✓ Modelos Multiecuacionales

## METODOLOGIA

### Metodología del Aprendizaje

El curso se desarrolla combinando clases magistrales, con estudios independientes de temas específicos. En las clases prácticas se ejemplifican las clases teóricas, mediante casos referidos a trabajos realizados sobre la economía argentina y la asistencia de los alumnos al gabinete de computación.

### Metodología de la Evaluación

La evaluación se realiza mediante la toma de dos parciales, cada uno de los cuales deberá aprobarse con calificación de cuatro puntos o más. Los alumnos que desaprobaren uno de ellos, tendrán la opción a un recuperatorio.

Para los alumnos libres se prevé un examen escrito, complementado con una exposición oral.

## ENCUADRE CONCEPTUAL

### **Unidad I**

Objetivo: Brindar las herramientas cuantitativas para la "explicación" de fenómenos económicos y financieros con regresores no estocásticos y a la luz del cumplimiento de los supuestos de Gauss-Markov.

Temas:

Modelo lineal general. Mínimos cuadrados clásicos. Supuestos de Gauss-Markov. Estimación, verificación, predicción.

### **Unidad II**



Objetivo: Evaluar el cumplimiento de los supuestos del modelo lineal general; analizar las consecuencias de su no cumplimiento y brindar un método para la estimación eficiente de los modelos.

Temas: Mínimos Cuadrados Generalizados. Autocorrelación. Heterocedasticidad. Multicolinealidad. Estimación, verificación y predicción

### **Unidad III**

Objetivo: Proporcionar los fundamentos metodológicos de la teoría de los procesos estocásticos y las herramientas metodológicas para la construcción de modelos de series de tiempo.

Temas: Modelos para procesos dinámicos. Proceso Estocástico. Estacionariedad. Modelos para series de tiempo estacionarias y series de tiempo no estacionarias. Identificación, estimación, tests y predicción. Procesos multivariados.

### **Unidad IV**

Objetivo: Brindar las herramientas para la construcción de modelos econométricos con regresores estocásticos.

Temas: Regresores Estocásticos. Modelos con rezagos distribuidos. Modelos simultáneos. Identificación. Estimación. Métodos de estimación de ecuaciones individuales. Métodos de estimación del sistema completo.

## **BIBLIOGRAFIA**

### Obligatoria

- 1) Gujarati, D.(2003) : "Basic Econometrics". 4º Edición. McGraw Hill. N.York.
- 2) Maddala, G.S. (2001) : "Introduction to Econometrics". J. Wiley & Sons.
- 3) Urbisaia H.L. y J.Z. Brufman (2001): "Análisis de Series de Tiempo. Univariadas y Multivariadas". Ed. Coop. - Distribuidora Cúspide. Buenos Aires. Buenos Aires. .

### Ampliatoria

- 1 Enders, W. (1995) : "*Applied Econometric Time Series*". John Wiley & Sons.
- 2 Greene, W.H. (1997) : "*Econometric Analysis*". 3º Edición. Prentice Hall. N. Jersey.
- 3 Harris, R. Sollis, R. (2003): "*Applied Time Series Modelling and forecasting*". Halsted Press.
- 4 Johnston, J. y J. Di Nardo (1997): "*Econometric Models*" 4º Edición. Mc Graw Hill. N,York.
- 5 Kedem,B. -Fokianos, K. (2002): "*Regression Models for time series analysis*". J. Wiley.