

PLAN DE TRABAJO DOCENTE DE ECONOMETRIA II PRIMER CUATRIMESTRE DEL AÑO 2000

1. DATOS DEL CURSO

Carrera: Licenciatura en Economía

Curso : Econometría II (868)

Carácter : Optativo

Departamento : Matemáticas

Año del plan de estudios: 1993

Ciclo, año y cuatrimestre de ubicación del curso: 5to. año, 1er. Cuatrimestre

Carga horaria semanal presencial de alumnos: 4 horas

Distribución de la carga horaria semanal presencial de alumnos: 2 hs. Prácticos
2hs teoría.

Cantidad de docentes: 1 Profesor 2 Auxiliares

Cantidad de comisiones: 1

2. COMPOSICION DEL EQUIPO DOCENTE

Aspectos teóricos: Licenciado Horacio Fuster

Título profesional: Estadístico, Licenciado en análisis de sistemas

Cargo Profesor titular

Aspectos prácticos: Licenciado Fernando Graña

Título profesional: Licenciado en Economía

Cargo Jefe de trabajos prácticos

Licenciada Natacha Liseras

Título profesional: Licenciado en Economía

Cargo Ayudante de 1ra

3. PROGRAMA ANALITICO

1. Procesos estocásticos.

Concepto.

Procesos estacionarios y ergódicos

Procesos lineales

2. Modelos lineales

Modelos autorregresivos (AR)

Modelos de medias móviles (MA)

Modelos mixtos (ARMA)

Procesos no estacionarios

3. Elaboración de modelos ARIMA

La etapa de identificación

Metodología para la elaboración de modelos ARIMA

Identificación de modelos estacionarios

Identificación de un modelo ARMA (p,q)

Análisis de estacionariedad

Identificación del término independiente

4. Estimación de un modelo ARMA

Planteo del problema

Enfoque condicional

Enfoque no condicional

5. Validación

Introducción

Análisis de los residuos

Análisis de los coeficientes estimados

Introducción de parámetros adicionales

Bondad del ajuste

Análisis de estabilidad

Reformulación del modelo

6. Predicción

Formas alternativas de presentar un modelo ARIMA

El predictor óptimo

Cálculo del predictor

Contrastes de hipótesis para evaluar la estabilidad estructural de la predicción

7. Modelos estacionales

Modelos estacionales puros y estacionarios
Modelos estacionales multiplicativos estacionarios
Modelos estacionales no estacionarios
Elaboración de un modelo ARIMA estacional

Módulo matemático

Operadores: de diferencias y retardos

Ecuaciones en diferencias
Ecuaciones ordinarias en diferencias finitas
Ecuaciones ordinarias en diferencias finitas lineales y con coeficientes
constantes
Solución general de la ecuación homogénea
Solución particular

4. BIBLIOGRAFIA

Modelos Econometricos Pyndick y Rubinfeld Editorial Labor universitaria

Análisis Econometrico _Greene Editorial Prentice Hall

Análisis de series temporales Ezequiel Uriel Editorial Paraninfo

Teoría econométrica Goldberger Editorial John Wiley

Modelos econométricos Pulido Ediciones Pirámide, Madrid

Times analysis Nelson

Forecasting economic time series Granger y Newbold Editorial Academic Press

Times series models Harvey Editorial Oxford

5. CRITERIOS DE EVALUACION

1. Se tomarán cinco exámenes parciales; un primero referido al módulo matemático, dos teóricos y dos prácticos.
2. Cada alumno deberá realizar un trabajo de aplicación que será evaluado.
3. Se tomarán exámenes de corta duración referidos a lecturas de libros
4. Asistencia al 80% de las clases prácticas

6. REQUISITOS PARA CURSAR LA MATERIA

1. Tener aprobado Econometría I
2. Mas de 10 alumnos menos de 40 (por uso de computadora)
3. Conveniente conocimiento de idioma Inglés.

7. CARGA HORARIA

4 hs. Semanales.

8. CRONOGRAMA DE CONTENIDOS Y EVALUACIONES PARCIALES

TEMAS	CLASES
Módulo matemático	2
Examen	1
Capítulos 1 y 2	4
Capítulo 3	2
Exámenes parciales	2
Capítulos 4 y 5	2
Capítulo 6	2
Capítulo 7	2
Exámenes parciales	2
Recuperatorios	2

9. FUNDAMENTACION DEL OBJETO DE ESTUDIO DEL CURSO

De los conocimientos que se brinden y de las aplicaciones tendrá el alumno una visión más acertada de las múltiples contribuciones que la materia ofrece a todas las áreas del conocimiento y de las posibilidades que le otorga contrarrestar la incertidumbre y, en consecuencia, el riesgo que caracteriza a los problemas económicos y sociales.

En particular la Econometría ofrece al economista los métodos más operativos que existen en la actualidad para dominar los fenómenos económicos.

El programa comprende, en términos generales, el desarrollo de modelos univariados para pronósticos de corto plazo, teniendo en cuenta condiciones de estacionariedad y ergodicidad así como elementos para su identificación, estimación y validación.

10.OBJETIVOS DE LA MATERIA

De los conocimientos que se brinden y de las aplicaciones que de los mismos se efectúe, dependerá que llegue o no, a tener una visión acertada de las múltiples y cada vez mas crecientes contribuciones que la materia ofrece a todas las áreas del conocimiento y de las posibilidades que le otorga para contrarrestar la incertidumbre, y en consecuencia el riesgo, que caracteriza a todos los problemas económicos y sociales.

El objetivo fundamental que la enseñanza de esta materia persigue es que el alumno obtenga conocimiento de operaciones y cálculos que le permitan analizar cuantitativamente la realidad a la que se enfrentará en el área de la economía para poder efectuar una correcta toma de decisiones.

- adquirir la preparación básica técnico científica de la asignatura.
- conocer el beneficio que le reportará la aplicación de cada uno de los conceptos y técnicas adquiridos.
- saber cómo y cuándo aplicarlos e interpretar los resultados.
- detectar errores y medirlos
- procurar la búsqueda de fundamentación científica
- estimular el análisis crítico
- desarrollar la imaginación para el logro de soluciones alternativas.
- Intentar respuestas originales.
- iniciar actividades de integración interdisciplinarias.
- estimular el desarrollo intelectual y ético de su personalidad.
- fomentar una actitud flexible, de apertura mental.

11.DESCRIPCION DE ACTIVIDADES DE APRENDIZAJE

Los alumnos desarrollarán las siguientes actividades:

- Lecturas dirigidas a la bibliografía de la materia.
- Practicas de computación en el laboratorio.
- Resolución de guías de trabajos prácticos.
- Elaboración de un trabajo de aplicación (es requisito su aprobación).