



Universidad Nacional de La Plata
Facultad de Ciencias Económicas

CARRERA: LICENCIADO EN ECONOMIA
PLAN VI
ASIGNACION HORARIA: 128
CATEDRA: ECONOMETRIA II
CODIGO DE MATERIA: 644
APROBACION: EXPTE. 900 - 21616. RES. N° 143/2000.

CONTENIDOS MÍNIMOS

ECONOMETRÍA II

- Modelo de ecuaciones simultáneas. Estimación: métodos. Análisis dinámico y simulación.
- Introducción al análisis de series de tiempo. Modelos univariantes. Series estocásticas. Modelos autorregresivos. El tema de la especificación.
- Estimación no lineal. Estimación de modelos de series temporales. Predicción: modelos.
- Funciones de transferencia. Concepto.
- Problemas econométricos. Modelos especiales. Función consumo y demanda. Funciones de producción y costos. Función de inversión.

ECONOMETRIA II

Facultad de Ciencias Económicas - Universidad Nacional de La Plata.

PROGRAMA – 2000

Prof. Hildegart Ahumada

1 – Revisión del Modelo Lineal General. Análisis crítico de los “supuestos”. Revisión de algunos conceptos de “Series de Tiempo”: “Estacionariedad”, “Estacionalidad”, “Modelos ARIMA”. La “Autocorrelación como Patología” en el modelo de regresión: una visión alternativa.

2 – Evaluación de modelos econométricos dinámicos en función de los distintos tipos de información: pasado relativo (Bondad del ajuste y residuos “Ruido Blanco – Innovación”); presente relativo (Validez del condicionamiento, el supuesto de “Exogeneidad Débil”); futuro relativo (Estabilidad de los Parámetros y Confiabilidad de las Predicciones); Teoría Económica; Medición de los Datos y Modelos Rivales (el principio de Englobamiento).

3 – Modelos dinámicos: una tipología, ventajas y limitaciones de los modelos más usados para la formulación de las estructuras dinámicas, como casos particulares del Modelo “Autoregresivo con Rezagos Distribuidos”. El Modelo de “Corrección de Errores”. Ejemplos referidos al caso argentino.

4 – Distintos enfoques para el estudio econométrico de series temporales. La metodología “General a Particular”: soluciones de largo plazo y modelación de los efectos de corto plazo.

5 – Otras Técnicas de Modelación de Series Temporales no estacionarias: Cointegración uniecuacional (estática). Tests de raíces unitarias. Sus limitaciones.

6 – El análisis de Vectores Autoregresivos. Algunos conceptos. Introducción al estudio de Cointegración por Sistemas como una síntesis de enfoques en el camino hacia una modelación dinámica de ecuaciones simultáneas.

Referencias Bibliográficas

- Ahumada H. (1991): “Notas Introdutorias a la Econometría Dinámica”, Serie Docente, Programa de Posgrado en Economía, ILADES, Georgetown University, Santiago de Chile.
- Ahumada, H. (1995): “Notas de Econometría dinámica: Una Exposición Simplificada”, mimeo, Instituto Di Tella.
- Banerjee A., Dolado J., Galbraith J. and Hendry D. (1993): “Cointegration, Error Correction and the Econometric Analysis of Non Stationary Data”, Oxford University Press, Oxford.

- Charemza W. and Deadman D. (1992): "New Directions in Econometric Practice", Elgar Publishing Limited.
- Doornik J. and Hendry D. (1996): "Empirical Econometric Modelling Using PcGive 9.0 for Windows", International Thomson Business Press.
- Ericsson N. and Irons J. (1994): "Testing Exogeneity", Oxford University Press, Oxford.
- Greene, W. (1999): "Econometric Analysis", 4th edition, Prentice Hall, New Jersey.
- Hendry D. (1995): "Dynamic Econometrics", Oxford University Press, Oxford.
- Hendry D. (1993): "Econometrics: Alchemy or Science?", Oxford University Press, Oxford.
- Johnston J. and DiNardo J. (1997): "Econometric Methods", 4th edition, Mc Graw Hill, New York.
- Stewart J. and Gill (1998): "Econometrics", 2nd edition, Phillip Allan.