



---

## Econometría II - 2do cuatrimestre 2020

### Curso modalidad virtual

---

- Profesores:** María Lorena Garegnani ([lgaregnani@bcra.gob.ar](mailto:lgaregnani@bcra.gob.ar))  
Gabriel V. Montes-Rojas ([gabriel.montes@fce.uba.ar](mailto:gabriel.montes@fce.uba.ar))
- Jefe de Trabajos Prácticos:** Laura Carella ([carella.laura@gmail.com](mailto:carella.laura@gmail.com))
- Ayudantes:** Fernando Banhero ([banhero4@gmail.com](mailto:banhero4@gmail.com))  
Javier Ibarlucía ([javier\\_ibarlucia@hotmail.com](mailto:javier_ibarlucia@hotmail.com))  
María Belén Ragone ([mbelenragone@gmail.com](mailto:mbelenragone@gmail.com))
- Página web de la materia:** <http://gabrielmontes.com.ar> y AU24
- Horarios:** Clases teóricas: Sábados 7-10hs (agosto y septiembre), Jueves 16-19hs (octubre y noviembre). Clases prácticas: Miércoles 7-10hs.
- Aula virtual:** Clases sincrónicas por **Zoom:**  
Clases teóricas: <https://zoom.us/j/99035807028>  
Clases prácticas: <https://zoom.us/j/99833111777>
- 

### OBJETIVOS

Samuelson, Koopmans y Stone (1954) definen a la Econometría como "...el análisis cuantitativo de fenómenos económicos actuales basado en un desarrollo conjunto de la teoría y las observaciones, ambas relacionadas por métodos apropiados de inferencia". En términos generales, la Econometría propone un desarrollo unificado de las mediciones y las teorías económicas. En este curso vamos a embarcarnos en el estudio de los métodos econométricos y a ilustrar con ejemplos y ejercicios empíricos su utilidad para responder preguntas cuantitativas acerca del comportamiento de las variables económicas y cómo se relacionan entre sí.

Econometría II se centra en los llamados modelos de series de tiempo, univariadas y multivariadas, y modelos de datos en panel.



## TEMARIO

1. Revisión del modelo lineal general uniecuacional. Introducción a regresores estocásticos y a la teoría asintótica. Criterios de evaluación de modelos econométricos.
2. Series de tiempo estacionarias. El concepto de estacionariedad. Introducción a modelos autoregresivos y de promedios móviles (ARMA). Función de autocovarianza, autocorrelación y autocorrelación parcial. Ecuaciones de Yule-Walker. Pronóstico y predicción.
3. 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.
4. Tópicos de series de tiempo. Cambios estructurales. Modelos no lineales (umbrales exógenos y endógenos). Modelos de heteroscedastidad condicional autoregresiva (ARCH). Volatilidad.
5. Modelos de series multivariadas. Introducción a la metodología de vectores autorregresivos (VAR). Causalidad en el sentido de Granger. Funciones impulso respuesta. Modelos VEC.
6. Modelos de datos en panel. Muestra longitudinal y cortes transversales agrupados. Modelos one-way y two-way. Efectos fijos, primeras diferencias y efectos aleatorios. Contraste de Hausman. Modelos anidados y clusters. Modelos de paneles dinámicos. Paneles heterogéneos.

## BIBLIOGRAFÍA

- 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. (2015) "Introducción a la Econometría: Un Enfoque Moderno". Thompson, Buenos Aires.



## SOFTWARE

Para la parte práctica se necesita usar un software econométrico, se recomienda **STATA**. Éste se puede bajar gratuitamente de <http://gabrielmontes.com.ar>, donde hay un archivo zippeado que tiene todos los componentes del software. Se descarga el Zip, se *copia&pega* en el directorio “C:/Program files”, y ya se puede usar clickeando en el EXE. Hay un instructivo en la página web. No hace falta instalarlo.

## SISTEMA DE EVALUACIÓN

- Para regularizar la materia se requiere tener una nota promedio de 4 o más. Esta nota está compuesta de un examen **obligatorio** al final de la cursada (**80%** de la nota, de la cual se requiere un mínimo de 4) y **2 trabajos prácticos (TPs) obligatorios (10%** de la nota cada uno, total 20% de la nota).
- Los alumnos que tienen una nota promedio de **7 o más** pueden tirar boleta en la mesa de finales libre de diciembre, sin rendir el final. Para ello deben anotarse en la mesa de diciembre.
- Los alumnos que tienen una nota promedio de **4 a 6.99**, tienen la opción de rendir un **recuperatorio** en la mesa de diciembre. Si la nota del recuperatorio es de 4 o más, se promedia la nota del recuperatorio con la de los 2 TPs y se aprueba la materia con esta nota. Si el recuperatorio tiene menos de 4 no se aprueba la materia y el alumno queda libre.
- Los TPs son grupales compuestos de un máximo de 4 alumnos. Se tiene que cumplir con la fecha de entrega estipulada de antemano.

Fecha de entrega de los TPs:

- Trabajo práctico 1: 31 de octubre 2020.
- Trabajo práctico 2: 30 de noviembre 2020.