
Econometría II – 1er cuatrimestre 2021

Curso modalidad virtual

Profesores: María Lorena Garegnani (lgaregnani@bcra.gob.ar)
Gabriel V. Montes-Rojas (gabriel.montes@fce.uba.ar)

Jefe de Trabajos Prácticos: Laura Carella (laura.carella@econo.unlp.edu.ar)
Ayudantes: Fernando Banhero (banhero4@gmail.com)
Javier Ibarlucía (javier_ibarlucia@hotmail.com)
María Belén Ragone (mbelenragone@gmail.com)

Página web de la materia: <http://gabrielmontes.com.ar> y AU24

Horarios: Clases teóricas: Sábados 7-10hs (marzo y abril), Jueves 16-19hs (mayo y junio). Clases prácticas: Miércoles 7-10hs.

Aula virtual: Clases sincrónicas por **Zoom**.

Clases teóricas: -> sábado <https://zoom.us/j/95205477255>
-> jueves <https://zoom.us/j/98301932249>
Clases prácticas: <https://zoom.us/j/92901841169>

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 autorregresivos 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 autorregresiva (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**.

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 agosto, sin rendir el final. Para ello deben anotarse en la mesa de agosto.
- Los alumnos que tienen una nota promedio de **4 a 6.99**, tienen la opción de rendir un **recuperatorio** en la mesa de agosto. 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: 12 de mayo 2021.
- Trabajo práctico 2: 16 de junio 2021.