



UNIVERSIDAD DEL SALVADOR

Facultad de Ciencias Económicas y  
Empresariales

Actuario  
(Carrera/s)

### PROGRAMA

<b>ACTIVIDAD CURRICULAR:</b>		Econometría			
<b>CÁTEDRA:</b>					
<b>TOTAL DE HS/SEM.:</b>		72/4		<b>TOTAL DE CRÉDITOS:</b>	
<b>SEDE:</b>	Centro	<b>CURSO:</b>	3ro	<b>TURNO:</b>	Noche
<b>AÑO ACADÉMICO:</b>		2020			
<b>URL:</b>					

1. CICLO:

	Superior/Profesional X
--	---------------------------

2. COMPOSICIÓN DE LA CÁTEDRA:

Docente	E-mail

3. EJE/ÁREA EN QUE SE ENCUENTRA LA MATERIA/SEMINARIO DENTRO DE LA CARRERA:

Matemática / Estadística

4. FUNDAMENTACIÓN DE LA MATERIA/SEMINARIO EN LA CARRERA:

La asignatura se ubica en el tercer año de la carrera con el objeto de complementar los conocimientos estadísticos para la formulación de modelos de evaluación de riesgos y situaciones micro y macroeconómicas que se presentan también en problemáticas de incertidumbre

5. OBJETIVOS DE LA MATERIA:

Que el alumno obtenga un manejo adecuado de las técnicas econométricas más usuales y de un software de uso generalizado, haciendo especial énfasis en el análisis de casos micro y macroeconómicos.

## 6. COMPETENCIAS A ADQUIRIR:

<b>Específicas</b>
<b>CE1 Integración de conocimientos estadísticos</b>
<b>CE2 Manejo de software específicos</b>
<b>CE3 Interpretación de resultados para la toma de decisiones</b>
<b>Transversales</b>
<b>CT1 Integración de conocimientos matemáticos</b>
<b>CT2 Integración interdisciplinaria</b>
<b>CT3 Contribución a la formación de la rentabilidad de la empresa</b>

## 7. ASIGNACIÓN HORARIA: *(discriminar carga horaria teórica y práctica para carreras que acreditan ante CONEAU)*

	<b>Teórica</b>	<b>Práctica</b>	<b>Total</b>
<b>Carga horaria</b>	36	36	72

## 8. ASIGNACIÓN DE CRÉDITOS:

	<b>Presencial<sup>1</sup></b>	<b>Dedicación<sup>2</sup></b>	<b>Total</b>	<b>Créditos</b>	
<b>Carga Horaria asociada</b>	72	36	108		→
<b>Porcentaje de Asignación</b>	34%	66%	100%		

### Distribución de las horas en las diferentes actividades

*(hacer doble click en el cuadro siguiente)*

<sup>1</sup> Carga horaria que figura por plan de estudios (Resolución Rectoral)

<sup>2</sup> Trabajo autónomo del estudiante

Actividad	Horas presenciales	Horas de trabajo autónomo	HORAS TOTALES
Clases teóricas	36		36
Clases prácticas			
- en el aula			0
- en el laboratorio	36	36	72
- en el aula de informática			0
- de campo			0
Tutorías			0
Actividades de Seguimiento online			0
Preparación de trabajos			0
Lectura autónoma y rastreo bibliográfico			0
Exámenes			0
Otras actividades (especificar)			0
<b>TOTAL</b>	<b>72</b>	<b>36</b>	<b>108</b>

## 9. UNIDADES TEMÁTICAS, CONTENIDOS, BIBLIOGRAFÍA POR UNIDAD TEMÁTICA:

### UNIDAD I

#### Introducción

##### 01) Objetivo de la Econometría

- Breve historia de su evolución metodológica.
- Concepto de Modelo Econométrico.
- Elementos Constitutivos.

### UNIDAD II

##### 01) El modelo clásico de la regresión

- Especificaciones.
- Estimación por Mínimos Cuadrados Clásicos (MCC).
- Propiedades de los Estimadores.
- Valuación de Resultados.
- Predicción.
- Restricciones Lineales entre coeficientes del modelo.
- Diferentes tests.
- Cambio Estructural: Tests de Crow.
- Modelos de Regresión con Variables Ficticias.

### UNIDAD III

##### 01) El modelo de regresión generalizado.

- El modelo de Mínimo Cuadrados Generalizados (MCG).
- Heteroscedasticidad. Principales tests.
- Estimación.
- Autocorrelación.

- Causas.
- Tests de Autocorrelación.
- Estimación y Predicción.

#### **UNIDAD IV**

##### **01) Otros problemas en el Modelo de Regresión Uniecuacional.**

- Multicolinealidad
- Principales causas y efectos sobre la calidad de las estimaciones.
- Estimación ante la presencia de multicolinealidad.
  
- Errores de Especificación.
- Omisión de Regresores Relevantes.
- Inclusión de Regresores no relevantes.
- Análisis de las propiedades de los estimadores.
  
- Modelo lineal con regresores Estocásticos
- Modelos con rezagos distribuidos.
- El Modelo de Expectativas Adaptativas.
- El Modelo de Ajustes Parciales
- Estimación.
- Modelo lineal de regresión logística para variables dependientes binarias.

#### **UNIDAD V**

##### **01) Modelos Multiecuacionales**

- Forma estructural, reducida y final del Modelo Econométrico.
- El problema de la Identificación.
- Condiciones de Rango y de Orden.
- Métodos de Estimación de Ecuaciones Individuales.
  - Mínimos Cuadrados Indirectos.
  - Variables Instrumentales.
  - Mínimos Cuadrados en Dos Etapas.

Bibliografía aplicable a todas las unidades temáticas:

Guajariti D. *Econometría Básica*. 3ra. edición. Mc Graw Hill, Bogotá, 1997.

Johnston J. Y J. Di Nardo. *Econometric Models*. 4ta. Edición. Mc Graw Hill, New York, 1997.

Maddala G. S. *Introducción a la Econometría*. 2 edición. Prentice Hall Hispanoamericana, México.

Novales A. *Econometría*. 2 edición. Mc Graw Hill, Interamericana de España, Madrid.

Urbisaia H. L. Y J. Z. Brufman. *Econometría, problemas y ejercicios*. Macchi, Buenos Aires, 1985.

Urbisaia H. L. Y J. Z. Brufman. *Análisis de Series de Tiempo. Univariadas y Multivariadas*. Buenos Aires, 2001.

Kmenta J. Elementos de Econometría. Vines Vives, Barcelona

Naeem Siddiqi – 2005 - “Credit Risk Scorecards: Developing and Implementing Intelligent Credit Scoring” - Wiley and SAS Business Series

**10. RECURSOS METODOLÓGICOS:** *(incluir modalidad y lugares de prácticas, junto con la modalidad de supervisión y de evaluación de las mismas)*

Exposición del docente y resolución de trabajos prácticos en aula/laboratorios

**11. CRITERIOS E INSTRUMENTOS DE EVALUACIÓN PARCIAL:**

Examen parcial y su recuperatorio escritos.

**12. RÉGIMEN DE PROMOCIÓN Y EVALUACIÓN FINAL:**

Sujeto a normas vigentes

**13. BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA:**

- Enders, W. (1995): “Applied Econometric Time Series”. John Wiley & Sons. New York.
- Greene, W.H. (1999): “Análisis Económico”. 3º Edición. Prentice Hall Iberia. Madrid.
- Johnston, J. y J. Di Nardo (1997): “Econometric Models” 4º Edición. Mc Graw Hill. New York.

**14. ORGANIZACIÓN SEMANAL DE LA ACTIVIDAD PRESENCIAL (Orientadora)**

*(Completar las unidades temáticas y marcar las columnas correspondientes con una cruz)*

**Nota:** En aquellos casos que la materia tenga una modalidad intensiva, consignar detalle de la actividad según corresponda (jornada, días)

Semana	Unidad Temática	Horas Teóricas	Horas Prácticas	Tutorías	Evaluaciones	Otras Actividades
1	Unidad 1	4				
2	Unidad 1	4				
3	Unidad 2	1	3			
4	Unidad 2	1	3			
5	Unidad 2 y 3	1	3			
6	Unidad 3	1	3			
7	Unidad 3	1	3			
8	Unidad 4	1	3			
9	Unidad 4	1	3			
10	Unidad 4	1	3			

<b>11</b>	<b>Unidad 4</b>	<b>1</b>	<b>3</b>			
<b>12</b>	<b>Unidad 5</b>	<b>1</b>	<b>3</b>			
<b>13</b>	<b>Unidad 5</b>	<b>1</b>	<b>3</b>			
<b>14</b>	<b>Unidad 5</b>	<b>1</b>	<b>3</b>			
<b>15</b>	<b>Parcial</b>	<b>1</b>	<b>3</b>			
<b>16</b>	<b>Recuperatorio</b>	<b>1</b>	<b>3</b>			
<b>17</b>	<b>TUTORÍA</b>					
<b>18<sup>3</sup></b>	<b>FINAL</b>		<b>4</b>			

**15. FIRMA DE DOCENTES:**

**16. FIRMA DEL DIRECTOR DE LA CARRERA**

---

<sup>3</sup> Considerar la cantidad de semanas en función del régimen de cursada de la materia. Ej. 18 semanas para las materias cuatrimestrales; 36 semanas para las materias anuales.