



UNIVERSIDAD DEL SALVADOR

Facultad de Ciencias Económicas y
Empresariales

Actuario
(Carrera/s)

PROGRAMA

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

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:

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

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

	Teórica	Práctica	Total
Carga horaria	36	36	72

8. ASIGNACIÓN DE CRÉDITOS:

	Presencial¹	Dedicación²	Total	Créditos	
Carga Horaria asociada	72	36	108		→
Porcentaje de Asignación	34%	66%	100%		

Distribución de las horas en las diferentes actividades
(hacer doble click en el cuadro siguiente)

¹ Carga horaria que figura por plan de estudios (Resolución Rectoral)

² 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
TOTAL	72	36	108

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			

11	Unidad 4	1	3			
12	Unidad 5	1	3			
13	Unidad 5	1	3			
14	Unidad 5	1	3			
15	Parcial	1	3			
16	Recuperatorio	1	3			
17	TUTORÍA					
18³	FINAL		4			

15. FIRMA DE DOCENTES:

16. FIRMA DEL DIRECTOR DE LA CARRERA

³ 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.