

# INSTITUTO DE DESARROLLO ECONÓMICO E INNOVACIÓN

Año: 2018



Universidad Nacional de Tierra del Fuego,  
Antártida e Islas del Atlántico Sur.

**PROGRAMA DE LA ASIGNATURA:**  
Econometría (ECO18)

**CÓDIGO:** ECO18  
**AÑO DE UBICACIÓN EN EL PLAN DE ESTUDIOS:**  
4 año  
**FECHA ULTIMA REVISIÓN DE LA ASIGNATURA:**  
2018-10-04  
**CARRERA/S:** Licenciatura en Economía V6,

**CARÁCTER:** CUATRIMESTRAL (1ro)  
**TIPO:** OBLIGATORIA  
**NIVEL:** GRADO  
**MODALIDAD DEL DICTADO:** PRESENCIAL  
**MODALIDAD PROMOCION DIRECTA:** SI  
**CARGA HORARIA SEMANAL:** 6 HS  
**CARGA HORARIA TOTAL:** 102 HS

## EQUIPO DOCENTE

Nombre y Apellido	Cargo	e-mail
Mariano Pereira	Adjunto	mpereira@untdf.edu.ar

## 1. FUNDAMENTACION

La econometría es una asignatura crucial en el desarrollo formativo de un licenciado en Economía. Ofrece al alumno una herramienta de aplicación para la identificación de relaciones causales con aplicaciones en todas las áreas de su desarrollo profesional.

## 2. OBJETIVOS

### a) OBJETIVOS GENERALES

El curso tiene como propósito estudiar el marco teórico y empírico para la modelización de fenómenos de naturaleza microeconómica. Durante el curso está previsto desarrollar diferentes técnicas econométricas que permitan formalizar el proceso de toma de decisiones de unidades económicas individuales tales como individuos, hogares, empresas, países, etc.

### b) OBJETIVOS ESPECIFICOS

Identificar las condiciones bajo las cuales es posible identificar un efecto causal.  
Integrar esta discusión en aplicaciones del campo de economía laboral, economía internacional y evaluación de impacto en políticas públicas

### **3. CONDICIONES DE REGULARIDAD Y APROBACION DE LA ASIGNATURA**

#### **a- EVALUACION**

\* Elaborar los trabajos prácticos, en forma individual o grupal, que serán presentados en clase o para su resolución fuera de los horarios de clase; y

\* Examen final escrito, teórico y práctico, al finalizar el período de clases

\* La calificación final provendrá en un 40% de la evaluación de los trabajos prácticos y el 60% restante del examen final.

#### **b- ASISTENCIA A CLASES**

Registrar asistencia al 75% de las clases teóricas y prácticas

## **4. CONTENIDOS DE LA ASIGNATURA**

### **I. Naturaleza de la Econometría y los Datos Económicos**

Conceptos Básicos

Etapas en el Análisis Empírico de Datos Económicos

Estructura de los Datos Económicos

Causalidad en Econometría

### **II. Modelo Lineal: Estimación Clásica**

Objetivo y Motivación

Análisis del Procedimiento de Mínimos Cuadrados Ordinarios (OLS)

Interpretación de Resultados

Propiedad de los Estimadores OLS

Eficiencia y Teorema de Gauss-Markov

### **III. Modelo Lineal: Inferencia**

Distribución Muestral de los Estimadores OLS

Contraste de Restricciones Lineales

Intervalos de Confianza

Interpretación de Resultados

### **IV. Modelo Lineal: Información Cualitativa**

Características de la Información Cualitativa

Uso de Variables Cualitativas en el Modelo Lineal

Interacción entre Variables Cualitativas y Cuantitativas

Contraste de Restricciones Lineales: Cambio Estructural

Modelo Lineal de Probabilidad

### **V. Heteroscedasticidad**

Efecto de la Heteroscedasticidad en los Estimadores OLS

Inferencia Robusta en Modelos Heteroscedásticos

Contraste de Heteroscedasticidad

Mínimos Cuadrados Generalizados (GLS)

### **VI. Modelo Lineal: Estimación por Variables Instrumentales**

Motivación: Endogeneidad en el Modelo Lineal

Omisión de Variables Relevantes

Estimador de Variables Instrumentales (IV)

Mínimos Cuadrados en Dos Etapas (2SLS)

Aplicaciones

## **5. RECURSOS NECESARIOS**

- Polycom
- Proyector
- Pc
- 

## **6. PROGRAMACIÓN SEMANAL**

Semana	Unidad / Módulo	Descripción	Bibliografía
1	1	Reg Lineal con dos variables: Estimación. Propiedades Algebraicas y Estadísticas. Supuestos de Gauss Markov. ANOVA. Calculo de desvio standard. Estimación por intervalos	Wooldridge: Cap 2
1	1	Práctica: Estimación y propiedades estadísticas	Wooldridge: Cap 2
2	2	Reg Lineal con mas de dos variables. Estrategia de identificacion: variables control	Wooldridge: Cap 3
2	2	Stata: Estrategia de Estimacion y Estrategía de Identificación	Wooldridge: Cap 3
3	2	No Linealidades. Tipos de Forma Estructural. Omisión de Vble Relevante e Inclusión de Vble Irrelevante	Wooldridge: Cap 3
3	2	Práctica: Lectura de salidas de estimacion e indicadores	Wooldridge: Cap 3
4	2	Aplicación: relación entre Exportaciones y Productividad. Estrategia de identificación	Wooldridge: Cap. 4
4	2	Stata: Estimacion con cambios en el efecto fijo y en las pendientes	Wooldridge: Cap. 4
5	3	Variables Binarias y Multinomiales. Test de Hipótesis: Significatividad Individual. Combinacion lineal .	Wooldridge: Cap. 7 y Cap. 4
5	3	Stata: Regresión Lineal. Variables Discretas. Post Estimación: Gráficos y Test de Hipótesis	Wooldridge: Cap. 7 y Cap. 4
6	4	Test de Hipótesis: Significatividad Conjunta o Global. Contraste de cambio estructural	Wooldridge: Cap 4
6	4	Stata: Regresión Lineal. Variables Discretas. Post Estimación: Gráficos y Test de Hipótesis	Wooldridge: Cap 4
7	5	Heterocedasticidad	Wooldridge: Cap 8
7	5	Práctica: Especificación de modelos.	Wooldridge: Cap 8
8		Repaso	
9		1er parcial	
10	6	Fuentes de Endogeneidad. Estrategia de Identificación: Variables Instrumentales I	Wooldridge: Cap. 15 y Cap. 16
11	6	Estrategia de Identificación: Variables Instrumentales II	Wooldridge: Cap. 15 y Cap. 16
11	6	Stata: Variables Instrumentales	Wooldridge: Cap. 15 y Cap. 16
12	6	Variables Instrumentales	Wooldridge: Cap. 10 y Cap. 11
12	6	Stata: Variables Instrumentales	Wooldridge: Cap. 10 y Cap. 11
13	6	Variables Instrumentales	Wooldridge: Cap. 10 y Cap. 11
13	6	Stata: Variables Instrumentales	Wooldridge: Cap. 10 y Cap. 11
14		Repaso: PARCIAL DE AÑOS ANTERIORES	
14		2do parcial	
15		Repaso: PARCIAL DE AÑOS ANTERIORES	

16		Recuperatorio y cierre de la materia	
----	--	--------------------------------------	--

## 7. BIBLIOGRAFIA DE LA ASIGNATURA

[1] Wooldridge, Jeffrey M.; "Introducción a la Econometría: Un Enfoque Moderno", 4ª. Edición. CENGAGE Learning, 2010.

[2] Stock, J. & Watson, Mark; "Introducción a La Econometría", 3ª. Edición. Pearson Editorial, 2012.

-----  
Firma del docente-investigador responsable

VISADO		
COORDINADOR DE LA CARRERA	DIRECTOR DEL INSTITUTO	SECRETARIO ACADEMICO UNTDF
Fecha :	Fecha :	