



Departamento de Ciencias Sociales. Carrera de Comercio Internacional.  
Programa para exámenes en condición de libres.  
Carga horaria semanal: 5hs. Cantidad de Créditos: 10. Modalidad: Presencial  
Núcleo: Orientación en Economía Internacional.

## Objetivos de la materia

El objetivo primordial es que el alumno posea el instrumental suficiente para ser capaces de realizar mediciones econométricas básicas, al tiempo de comprender y analizar adecuadamente los estadísticos de una salida de resultados.

En todos los sentidos el programa es muy ambicioso y requerirá una dedicación elevada en cuanto a las lecturas y prácticas a realizar. No se abordan temas de última generación tales como regresiones no lineales, ni se hará uso del álgebra matricial. Pero el alumno deberá poseer los conocimientos suficientes para comprender y proseguir profundizando en el análisis econométrico al tiempo de ser capaz de realizar mediciones econométricas básicas e interpretar sus resultados.

## PROGRAMA Y BIBLIOGRAFIA

El material bibliográfico que se utilizará a lo largo de todo el curso esta contenido en:

- Damodar N. Gujarati. Econometría. McGraw-Hill, cuarta edición, México 2004.

### Temario por Unidades.

#### Unidad 1: Capítulo 1, 2 y 3

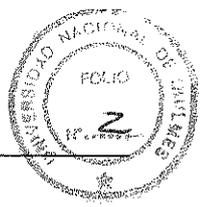
- Presentación. Introducción. Naturaleza del análisis de regresión; algunos comentarios. Mínimos Cuadrados Ordinarios. Linealidad de la función de regresión poblacional y muestral. Análisis de regresión con dos variables. Modelo clásico de regresión lineal: Supuestos detrás del método de mínimos cuadrados.

#### Unidad 2: Capítulo 4 y 5

- Supuesto de normalidad. Modelo Clásico de Regresión Lineal (MCRLN). Propiedades de los estimadores bajo supuesto de normalidad. Regresión con dos variables. Estimación de intervalos y pruebas de hipótesis.

#### Unidad 3: Capítulo 6, 7 y 8

- Extensión del modelo de regresión lineal de dos variables. Análisis de regresión múltiple: Problemas de estimación. Modelos logarítmicos y semilogarítmicos, interpretación de resultados de los coeficientes estimados. Análisis de regresión múltiple



problemas de Estimación. Análisis de robustez de la estimación. Problemas de inferencia.

**Unidad 4: Capítulo 10, 11 y 12**

- Violación de los supuestos del modelo clásico de regresión lineal. Naturaleza del problema y posibles soluciones para: Multicolinealidad y muestras pequeñas; Heterocedasticidad; y Autocorrelación.

**Unidad 5: Capítulo 16**

- Modelo de regresión con datos de panel. Modelo de efectos fijos y modelo de efectos aleatorio. Análisis de resultados y posibles problemas de estimación.

**Unidad 6: Capítulo 21**

- Econometría de series temporales. Procesos estocásticos de raíz unitaria. Fenómeno de regresión espuria. Pruebas de raíz unitaria y solución de problemas para series  $I(1)$  y regresión espuria. Análisis de cointegración Engle – Granger y Johansen. Cointegración con cambio estructural, conceptos introductorios y propuesta Gregory Hansen.

**METODOLOGIA de EVALUACION**

Examen en el que se solicitará la realización de una análisis de regresión, solución de problemas y evaluación de resultados.