

Econometría Avanzada – 2019
Maestría en Economía
Universidad Nacional de La Plata

Profesores:

- Carlos Lamarche (clamarche@uky.edu)
- Mariana Marchionni (marchionni.mariana@gmail.com)
- Javier Alejo (javieralejo@gmail.com)
- Asistentes: Pablo de la Vega (pablo_dlv@outlook.com), Juan Martín Pal (juanmartinpal@gmail.com), Jessica Bracco (braccojessica@gmail.com), Ivana Benzaquen (ivanabenzaquen@gmail.com)

Fechas y horarios de clases:

- Prof. Lamarche (CL): viernes 14, 21 y 28/06 y 5/07, de 16 a 20hs.
- Profs. Marchionni (MM)/Alejo (JA): miércoles 7, 14, 21, 28/08, 4 y 11/09, de 17 a 20hs.
- Horarios de consulta: a confirmar.

Programa

Clase (prof.)	Temario	Bibliografía (libro, capítulo)
1 (CL)	El modelo lineal: Esperanzas condicionales, efectos parciales promedios y elasticidades. Supuestos clásicos y Teorema de Gauss Markov. Estimación: mínimos cuadrados ordinarios y método de momentos. Proyecciones y teorema de Frish-Waugh y Lovell. Sesgo. Estimación de la varianza bajo distintos supuestos. Variables omitidas. Inferencia.	Notas de clase, WO 1 & 2 DM 2 & 3
2 (CL)	Teoría de las muestras grandes: Teoría asintótica como herramienta. Resultados de convergencia, ley de los grandes números y teorema de los grandes números. Consistencia y distribución asintótica de estimadores clásicos.	Notas de clase, WO 3, HA 2
3 (CL)	Variables Instrumentales: Endogeneidad: ejemplos básicos. Estimación de variables instrumentales y método de dos etapas. Propiedades de muestra grande. Instrumentos débiles y sesgos. Sobre identificación y test. Sistema de ecuaciones.	Notas de clase, WO 5 & 8, AP 10
4 (CL)	Método de Momentos Generalizados: Definiciones básicas. Estimador de MMG: consistencia y distribución asintótica. Eficiencia, instrumentos y propiedades de muestras chicas. Máxima Verosimilitud: Máxima verosimilitud y score. Estimador de máxima verosimilitud: consistencia y distribución asintótica. Tests de Wald, cociente de verosimilitud y test de score. Estimador de máxima verosimilitud restringido.	Notas de clase, WO 14, HA 3 Notas de clase, DM 10, HA 7, WO 13
5 (MM)	Datos en paneles: componentes de errores. Efectos fijos y aleatorios. Estimación e inferencia. Test de Hausman.	WO 10, BA 1 & 2
6 (JA)	Modelos con variable dependiente limitada: logits, probits, tobits. Variables latentes.	WO 15, 16 & 17
7 (JA)	Selectividad muestral: Sesgo de selección, el estimador de Heckman en dos etapas y máximo verosímil. Problemas computacionales.	WO 17, CT 16
8 (MM)	Introducción a los métodos no-paramétricos. Estimación de densidades por el método de promedios ponderados o Kernels. Propiedades, elección óptima del ancho de banda. Estimadores con ancho de banda variable, estimación de densidades multivariadas. La maldición de la dimensionalidad.	LR 1, PU 2
9 (MM)	Estimación no paramétrica y semiparamétrica de regresiones. El estimador de Nadaraya-Watson. Estimadores locales lineales y polinómicos. Esperanza condicional parcialmente lineal.	PU 3, LR 2&6

Libros:

No hay libros de lectura obligatoria, pero los siguientes son una fuente útil de consulta:

- Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data; Wooldridge, J. (2010), MIT Press (WO)
- Econometrics; Fumio Hayashi (2000), Princeton University Press (HA)
- Mostly Harmless Econometrics; Angrist, J., and Pischke, J-S. (2009), Princeton University Press (AP)
- Econometrics Theory and Methods; Davidson, R. and MacKinnon, J. G. (2004), Oxford University Press (DM)
- Econometric Analysis of Panel Data; Baltagi, B. (2005), 3rd edition, Wiley, New York. (BA)
- Microeconometrics: Methods and Applications; Cameron, A.C., and Trivedi, P.K. (2005), Cambridge University Press. (CT)
- Nonparametric Econometrics; Li, Q. and J. S. Racine (2007), Princeton University Press. (LR)
- Nonparametric Econometrics; Pagan, A. and Ullah (1999), Cambridge University Press. (PU)