

Econometría Avanzada Parte II – 2023

Docentes

- Profesora: Mariana Marchionni (marchionni.mariana@gmail.com)
- Asistentes: Jessica Bracco (braccojessica@gmail.com), Ivana Benzaquen (ivanabenzaquen@gmail.com) y Luis Laguinge (luislaguinge4@gmail.com).
- Profesor invitado: Walter Sosa Escudero (waltersosaescudero@gmail.com)

Objetivo

En esta parte del curso vamos a estudiar cómo estimar algunos modelos econométricos de uso extendido en microeconometría. En las clases se buscará familiarizar a los alumnos con los aspectos conceptuales y teóricos de distintos modelos para que luego se enfrenten a las aplicaciones propuestas en los trabajos empíricos domiciliarios, donde podrán desarrollar la capacidad de identificar cuál es la herramienta econométrica adecuada para cada modelo particular y por qué.

Modalidad y fechas de clases

- **Teoría**
 - Son 6 clases en total: 1, 8, 15, 22 y 29 de agosto y 5 de septiembre. Trataremos un tema por clase (ver temario debajo). Las clases serán presenciales.
 - Como material complementario, para cada clase dispondrán de una presentación en pdf, videos y una guía de preguntas para ejercitación. Todo el material estará disponible en el Aula Virtual.
- **Práctica**
 - Las clases de práctica estarán disponibles en videos en el Aula Virtual.
 - Habrá clases de consulta virtuales y optativas los viernes 11 y 25/8 y 15/9 a las 17hs por Zoom.

Evaluación

- Será mediante 3 evaluaciones prácticas domiciliarias individuales y una evaluación final teórica presencial con preguntas/ejercicios similares a los de las guías de preguntas. Para aprobar esta parte del curso, cada evaluación se debe aprobar con al menos 6 (seis) puntos.
- La nota final de esta parte del curso es un promedio simple de estas 4 evaluaciones. Esa nota luego se promedia con la de la primera parte del curso para obtener la nota final de la materia.
- Ver debajo el cronograma de entregas y evaluaciones.

Bibliografía básica

Los siguientes libros/papers son una fuente útil de consulta sobre los temas del curso:

- Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data; Wooldridge, J. (2010), MIT Press (WO)
- 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)

Temario y cronograma

Clase	Tema	Bibliografía (libro, capítulo)	Evaluaciones individuales domiciliarias
Clase 1 (1/8)	Datos en paneles: modelo de componentes de errores. Estimador del modelo con efectos fijos: modelo con dummies por individuo y modelo within. Estimador del modelo con efectos aleatorios. Test de Hausman.	WO 10, BA 1&2	1. Modelos para datos en panel (sobre los temas de la clase 1). Entrega: 15/8.
Clase 2 (8/8)	Modelos con variable dependiente limitada: censura, truncamiento y variable dependiente binaria. Modelos de probabilidad lineal, modelos Probit y Logit. Interpretación, ventajas y limitaciones.	WO 15, 16 & 17	2. Selección muestral y censura (sobre los temas de las clases 2 y 4). Entrega: 29/8.
Clase 3 (15/8)	Introducción a big data y machine learning para economistas (prof. Walter Sosa Escudero, a confirmar si es presencial o por Zoom).		
Clase 4 (22/8)	Selectividad muestral. Distintos mecanismos de selectividad muestral y sus consecuencias sobre el sesgo del estimador de MCO. Sesgo de selección como error de especificación. Estimador de Heckman en dos etapas.	WO 17, CT 16	
Clase 5 (29/8)	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	3. Modelos no paramétricos (sobre los temas de las clases 5 y 6). Entrega: 19/9.
Clase 6 (5/9)	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	
Examen final (12/9)	Examen presencial.		