

**Econometría Avanzada 2023**  
**Programa de la primera parte de la materia**

**Profesores:**

- Primera Parte: Prof. Carlos Lamarche (email: [clamarche@uky.edu](mailto:clamarche@uky.edu); página web: [carloslamarche.com](http://carloslamarche.com))  
 Asistentes: Fabián E. González ([fabian.e.gonzalez97@gmail.com](mailto:fabian.e.gonzalez97@gmail.com)), Agostina Zulli ([agostinazulli@gmail.com](mailto:agostinazulli@gmail.com))

**Fechas y horarios de clases:**

- Prof. Lamarche:
  - Clases presenciales: 7/06, 14/06, 21/06 y 28/06, de 17 a 20hs.
  - Horarios de consulta: a confirmar.
  - Material de lectura: disponible en el aula virtual a partir de 01/06

**Programa**

Clase	Temario	Material: libro, capítulo, y videos
1	<b>El modelo lineal:</b> 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	<b>Teoría de las muestras grandes:</b> 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	<b>Variables Instrumentales:</b> 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	<b>Método de Momentos Generalizados:</b> Definiciones básicas. Estimador de MMG: consistencia y distribución asintótica. Eficiencia, instrumentos y propiedades de muestras chicas.	Notas de clase, WO 14, HA 3
5	<b>Máxima Verosimilitud:</b> 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, DM 10, HA 7, WO 13

**Material de lectura:** En el aula virtual se puede acceder a notas de clase y videos correspondientes a cada semana.

**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)