

Econometría Avanzada Parte II – 2020

Docentes

- Profesora a cargo: Mariana Marchionni (marchionni.mariana@gmail.com)
- Profesora invitada: Belén Michel Torino (belenmichel@gmail.com)
- Asistentes: Jessica Bracco (braccojessica@gmail.com) e Ivana Benzaquen (ivanabenzaquen@gmail.com)

Objetivo

Esta parte del curso tiene por objetivo estudiar algunos métodos de econometría avanzada que constituyen el instrumental básico para el análisis microeconómico. En las clases se buscará familiarizar a los alumnos con los aspectos conceptuales y teóricos de distintos métodos 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 problema y configuración de los datos.

Modalidad y fechas de clases

- Son 6 clases en total y trataremos un tema por clase siguiendo el temario que se detalla debajo.
- Para cada clase dispondrán de una presentación en pdf, videos y reuniones por Zoom para consultas.
- Los videos estarán disponibles cada miércoles: 5, 12, 19 y 26 de agosto y 2 y 9 de septiembre.
- Las reuniones por Zoom serán también los miércoles a las 17hs, empezando el 5/8. En la primera reunión haremos una presentación del curso y en las siguientes se discutirán dudas de los temas de la semana previa.

Evaluación

- Será mediante trabajos prácticos domiciliarios e individuales.
- Cada alumno/a deberá entregar resueltos los 3 trabajos prácticos. Cada trabajo práctico tendrá una ponderación de 1/3 en la calificación de esta parte del curso.
- Habrá clases de consulta por Zoom para la resolución de los trabajos prácticos, en fechas y horarios a confirmar con las asistentes.

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. (CI)
- Nonparametric Econometrics; Li, Q. and J. S. Racine (2007), Princeton University Press. (LR)
- Nonparametric Econometrics; Pagan, A. and Ullah (1999), Cambridge University Press. (PU)
- Machine learning: An applied econometric approach; Mullainathan, S. and J. Spiess (2017). Journal of Economic Perspectives, 31(2): 87-106. (MS)

Temario

Clase	Tema	Bibliografía (libro, capítulo)	Evaluaciones individuales domiciliarias
1	Datos en paneles: modelo de componentes de errores. Estimador de efectos fijos: modelo con dummies por individuo y modelo within. Estimador de aleatorios. Test de Hausman.	WO 10, BA 1&2	1. Modelos para datos en panel (sobre los temas de la clase 1)
2	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 3)
3	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	
4	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 4 y 5)
5	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	
6	Machine Learning. Descubrir patrones generalizables con Big Data. Modelos (supervisados) de predicción y clasificación.	MS	