

**Econometría Avanzada 2020**  
**Programa de la primera parte de la materia**

**Profesores:**

- Primera Parte: Carlos Lamarche ([clamarche@uky.edu](mailto:clamarche@uky.edu))
- Asistentes: Pablo de la Vega ([delavegapc@gmail.com](mailto:delavegapc@gmail.com)), Juan Martín Pal ([juanmartinpal@gmail.com](mailto:juanmartinpal@gmail.com)), Luis Laguinge ([luislaguinge4@gmail.com](mailto:luislaguinge4@gmail.com))

**Fechas y horarios de clases:**

- Prof. Lamarche:
  - Clases usando videos: 10/06, 17/06, 24/06, 1/07 y 8/07
  - Clases usando Zoom: 17/06, 24/06, 1/07 y 8/07, de 18 a 19hs.
- Horarios de consulta: a confirmar.

**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 Videos de 10/06
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 Videos de 17/06
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 Videos de 24/06
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 Videos de 1/07
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 Videos de 8/07

**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)