



Maestría en Econometría

MICROECONOMETRIA I

Tercer Trimestre de 2023

Profesor:

Martín González Rozada (mrozada@utdt.edu)

Clases Teóricas: Martes de 19:15 a 22:00. Aula A103

Ayudante:

Romina Maiorano (maioranoromina@outlook.com)

Clases Prácticas: Sábados de 9:00 a 11:00.

Programa de Clases

- **Semanas 1 a 4: Modelos Logit y Probit. Modelos para variables discretas binarias.** Características, estimación e inferencia estadística. Interpretación de los coeficientes estimados. Medidas de bondad del ajuste. Relación entre el modelo Logit y el análisis discriminante. Heterocedasticidad y endogeneidad. Estimación utilizando Stata. Cameron & Trivedi, cap. 14. Wooldridge, cap. 15.
- **Semanas 5 y 6: Modelos para variables categóricas ordenadas y no ordenadas.** Modelos para variables discretas categóricas ordenadas y no ordenadas. Modelos multinomiales Logit y Probit. Modelos Logit y Probit ordenados. Características, estimación e inferencia estadística. Interpretación de los coeficientes estimados. Medidas de bondad del ajuste. Estimación utilizando Stata. Cameron & Trivedi, cap. 15 y 20. Wooldridge, cap. 16 y 18. Maddala, G. S. (1983).
- **Semanas 7 y 8: M-estimation** Estimación general de modelos no lineales. Estimadores M donde la “M” quiere decir minimización o maximización de alguna función objetivo. Estimación de un paso y de dos pasos. Inferencia estadística. Wooldridge, cap. 12.

- **Semana 9: Modelos para variables censuradas y truncadas** Modelos para variables discretas no categóricas. Modelo Tobit. Características, estimación e inferencia estadística. Modelos de selección. Características, estimación e inferencia estadística. Estimación utilizando Stata. Cameron & Trivedi, cap. 16. Wooldridge, caps. 17 y 19. Maddala, G. S. (1983).
- **Semana 10: Modelos de duración** Datos para estimar modelos de duración. Función “hazard” sin covariables, con covariables constantes en el tiempo y con covariables que varían en el tiempo. Función de supervivencia. Modelo de Cox. Heterogeneidad no observada. Características, estimación e inferencia estadística. Estimación utilizando Stata. Wooldridge, cap. 22. Jenkins, S.P. (2005). Kiefer, N.M. (1988).
- **Extra (si llegamos): modelos no paramétricos y semi-paramétricos.** Estimación por densidades univariantes y multivariantes. Selección óptima del ancho de la ventana de estimación. Métodos del histograma y estimación “naïve”. Diferentes kernels usados en la estimación. Modelos de regresión no paramétrica. Modelos de regresión semi-paramétrica. Estimación utilizando Stata y R. Pagan y Ullah; Li y Racine.

Bibliografía Básica Sugerida

- Cameron, A. C. and Trivedi P. K. (2005). *Microeconometrics: Methods and Applications*, Cambridge University Press.
- Jenkins, S.P. (2005) *Survival Analysis*, mimeo. [Web link](#)
- Li, Q. and Racine, S. (2006), *Nonparametric Econometrics: Theory and Practice*. Princeton: Princeton University Press.
- Kiefer, N.M. (1988), *Economic Duration Data and Hazard Functions*, Journal of Economic Literature, Vol. XXVI, pp. 646-679.
- Maddala, G. S. (1983). *Limited Dependent and Qualitative Variables in Econometrics*, Cambridge University Press.
- Pagan, A. and Ullah, A. (1999), *Nonparametric Econometrics*. Cambridge: Cambridge University Press.
- Wooldridge, J. (2012) *Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data*, MIT Press: Cambridge.

Evaluación Los alumnos serán evaluados en base a un examen final domiciliario. La nota final de la materia será una letra de acuerdo a la escala oficial de la UTDT.

Material de Clase

Las notas de clase estarán publicadas en el campus virtual de la universidad campusvirtual.utdt.edu
Para tener acceso al mismo hay que estar inscripto en la materia. Para cualquier problema relacionado con el acceso al campus virtual se debe contactar a soporte@utdt.edu