



Maestrías en Economía y en Econometría

ECONOMETRIA Tercer Trimestre de 2023

Profesor:

Martín González Rozada (mrozada@utdt.edu)

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

Ayudante:

Romina Maiorano (maioranoromina@outlook.com)

Clases Prácticas: Sábado de 11:00 a 13:00.

Programa de Clases

- **Semanas 1 a 4: Causalidad en Econometría. Modelo de resultados potenciales.**
Teoría de mínimos cuadrados clásicos I. Estimación e inferencia. Modelo de regresión lineal simple y múltiple. Estimación por mínimos cuadrados clásicos (MCC). Propiedades de muestra finita y asintótica de los estimadores de MCC. Inferencia estadística.
- **Semanas 5 a 8: Teoría de mínimos cuadrados clásicos II**
Variables relevantes omitidas, causalidad simultánea y error de medición en las variables. Propiedades de los estimadores de MCC. Variables proxy. Variables instrumentales y función de control para resolver la endogeneidad. Mínimos cuadrados en dos etapas. Errores no esféricos. Estimación, inferencia y propiedades de mínimos cuadrados clásicos. Propiedades de mínimos cuadrados generalizados. Heterocedasticidad y correlación serial.
- **Semana 9: Máxima Verosimilitud** Máxima verosimilitud, estimación y propiedades. Inferencia estadística. Sesgo de selección por truncamiento incidental. Modelo Probit.
- **Semana 10: Sistemas de ecuaciones** Ecuaciones aparentemente no relacionadas. Ecuaciones simultáneas. Inferencia. Variables instrumentales. Identificación.

Bibliografía Básica Sugerida

- Hansen, Bruce *Econometrics*, Princeton, NJ: Princeton University Press, 2022.
- Angrist, J. and Pischke JS *Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion*, Princeton University Press. 2008.
- Greene, W.H., *Econometric Analysis*, 5th Ed., Upper Saddle River, NJ: Prentice Hall, 2003.
- Hayashi, F., *Econometrics*, Princeton, NJ: Princeton University Press, 2000.
- Holland, Paul W.(1986): "Statistics and Causal Inference." *Journal of the American Statistical Association* 81, 945-70.
- Johnston, J., and DiNardo, J., *Econometric Methods*, 4th Ed., London: McGraw Hill, 1997.
- Ruud, P.A., *An Introduction to Classical Econometric Theory*, Oxford: Oxford University Press, 2000.

Evaluación Los alumnos serán evaluados en base a un ejercicio práctico individual y un examen final presencial. El examen final representa el 60 % de la nota numérica. La nota final de la materia será una letra de acuerdo a la escala oficial de la UTDT. Para aprobar la materia es **indispensable aprobar el examen final**.

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

Clases Híbridas

Para aquellos inscriptos en la MEC las clases se dictan en forma híbrida.