

Universidad Torcuato Di Tella

Maestrías en Economía y en Econometría

ECONOMETRIA

Tercer Trimestre de 2015

Profesor:

Martín González Rozada (mrozada@utdt.edu)

Clases Teóricas: Miércoles de 19:15 a 22:00. Aula A201.

Ayudante:

Victoria Barone (viquibarone@gmail.com)

Clases Prácticas: Sábados de 9:00 a 11:00. Aula A108.

Programa de Clases

- **Semanas 1 y 2: Teoría de mínimos cuadrados clásicos I**
Modelo de regresión lineal. Estimación por mínimos cuadrados clásicos (MCC). Propiedades de muestra finita y asintótica de los estimadores de MCC. Inferencia estadística.
- **Semanas 3, 4 y 5: Teoría de mínimos cuadrados clásicos II**
Errores de especificación. Variables relevantes omitidas y variables irrelevantes incluidas. Variables proxy. variables instrumentales. 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.
- **Semanas 6 y 7: Máxima Verosimilitud**
Máxima verosimilitud, estimación y propiedades. Inferencia estadística. Sesgo de selección por truncamiento incidental. Modelo Probit.
- **Semanas 8, 9 y 10: Sistemas de ecuaciones**
Ecuaciones aparentemente no relacionadas. Ecuaciones simultáneas. Inferencia. Variables instrumentales. Identificación.

Bibliografía Básica Sugerida

- Greene, W.H., *Econometric Analysis*, 5th Ed., Upper Saddle River, NJ: PrenticeHall, 2003.
- Hayashi, F., *Econometrics*, Princeton, NJ: Princeton University Press, 2000.
- Johnston, J., and DiNardo, J., *Econometric Methods*, 4th Ed., London: McGrawHill, 1997.
- Ruud, P.A., *An Introduction to Classical Econometric Theory*, Oxford: Oxford University Press, 2000.

Evaluación

Los alumnos serán evaluados en base a ejercicios prácticos que cuentan por el 40% de la nota total y un examen final presencial que cuenta por el 60% restante de la nota total. Los ejercicios prácticos pueden resolverse en grupos de estudiantes de no más de 3 (tres) personas. Se entregará un solo práctico por grupo. 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 de la misma.](#)

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