

# 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](http://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](mailto:sopORTE@utdt.edu)