

Econometría
Programa en Economía Aplicada
UTDT - 2011-

Prof. Hildegart Ahumada

Objetivos

El propósito del curso es brindar a los alumnos los conceptos básicos necesarios para el uso de modelos econométricos con fines de análisis económico, pronóstico y evaluación de políticas. Este curso se centrará en la aplicación práctica de tales modelos utilizando STATA. En particular, se estudiará el método de MCO, se analizarán los supuestos detrás de la teoría tradicional y se presentarán los criterios de evaluación más apropiados. Asimismo, se discutirá cuándo deberán usarse otros métodos de estimación. El curso busca también introducir a los alumnos a las áreas específicas dentro de modelos econométricos: series temporales, datos de panel y variables dependientes limitadas.

En todos los casos se pondrán en práctica los conceptos estudiados con las series que los alumnos deseen trabajar.

Programa del curso

1. Objetivos de la Econometría. Fuentes de Información. Revisión de Algebra Matricial y del Modelo de Regresión Simple.
2. El Modelo de Regresión Lineal Múltiple. El Método de Mínimos Cuadrados (MCO).
3. Propiedades de los estimadores MCO. Evaluación de Modelos: criterios de Bondad del Ajuste.
4. Omisión de Variables Explicativas e Inclusión de Irrelevantes. Tests de Restricciones Lineales.
5. Predicción y Pronóstico. Estabilidad de los parámetros. Variables Dummies.
6. "Violación" de los Supuestos Clásicos: Heteroscedasticidad y Autocorrelación. Mínimos Cuadros Generalizados. Otros "problemas": multicolinealidad.
7. Algunos conceptos de Teoría Asintótica. Estimadores de Máxima Verosimilitud.
8. Distintos Criterios de Evaluación de Modelos Econométricos.
9. Introducción a los modelos de Datos de Panel: Efectos Fijos y Aleatorios

10. Introducción a Modelos No-lineales y con Variables Explicativas Qualitativas.

11. Introducción a Modelos Dinámicos y a la Econometría de "Procesos Integrados".

12. Introducción al concepto de "Exogeneidad". Método de Variables Instrumentales. Modelos de Ecuaciones Simultáneas: Identificación y Estimación.

Bibliografía

- Baum C (2003), *An Introduction to Modern Econometrics Using Stata*, Stata Press.
- Charemza W and Deadman D. (1997), 2nd Ed., *New Directions in Econometric Practice: General to Specific Modelling, Cointegration, and VAR*, Elgar Pub. Lim
- Favero, C. (2001) *Applied Macroeconometrics*, Oxford University Press
- Greene W. (2009), *Econometric Analysis*, 6th Ed., Prentice-Hall, Inc.
- Hendry, D.F. and Nielsen, B. (2007) *Econometric Modeling: a Likelihood Approach*, Princeton University Press.
- Intriligator, Bodkin and Hsiao (1996), 2nd ed. *Econometric Models, Techniques and Applications*
- Johnston J. and Dinardo J (1997) *Econometric Methods*, 4 ed, Mc Graw Hill.
- Stewart J. And Gill (1998), 2nd Ed. *Econometrics*, Phillip Allan.
- Verbeek M. (2004), *A guide to Modern Econometrics*, Willey and Sons, Ltd
- Wooldridge J. (2009) *Introductory econometrics : a modern approach*, Mason, OH.