

Universidad Torcuato Di Tella  
Maestría en Economía y Maestría en Econometría

ECONOMETRIA

Tercer Trimestre de 2011

**Profesor:**

Martín González Rozada (mrozada@utdt.edu)

Clases Teóricas: Jueves de 19:15 a 21:30. Sede Miñones.

**Ayudante:**

Martín Trombetta (martintrombetta@gmail.com)

Campus Virtual: <http://utdt.edu/campuseconomia>

**Bibliografía Básica Sugerida**

- Berndt, Ernst R., *The Practice of Econometrics -Classic and Contemporary-*. Addison-Wesley, USA, 1990.
- Davidson, J., *Econometric Theory*, Oxford: Blackwell Publishers, 2000.
- Davidson, R., and MacKinnon, J.G., *Estimation and Inference in Econometrics*, Oxford: Oxford University Press, 1993.
- Greene, W.H., *Econometric Analysis*, 5th Ed., Upper Saddle River, NJ: PrenticeHall, 2003.
- Hamilton, J., *Time Series Analysis*, Princeton, NJ: Princeton University Press, 1994.
- 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.

## Clases

- **Semanas 1, 2 y 3: Teoría de mínimos cuadrados clásicos I**  
Modelo de regresión lineal. Estimación por mínimos cuadrados. Propiedades muestrales de los estimadores. Inferencia estadística. Teoría asintótica básica.
- **Semanas 4, 5 y 6: Teoría de mínimos cuadrados clásicos II**  
Errores de especificación. Variables relevantes omitidas y variables irrelevantes incluidas. Multicolinealidad. Cambio estructural. Contrates de estabilidad del modelo. Predicción.
- **Semanas 7, 8 y 9: Teoría de mínimos cuadrados generalizados**  
Errores no esféricos. Estimación, inferencia y propiedades de mínimos cuadrados clásicos. Propiedades de mínimos cuadrados generalizados. Heterocedasticidad y correlación serial. Máxima verosimilitud, estimación y propiedades. Inferencia estadística.
- **Semanas 10, 11 y 12: Sistemas de ecuaciones**  
Ecuaciones aparentemente no relacionadas. Ecuaciones simultáneas. Inferencia. Variables instrumentales. Identificación.

## Evaluación

Los alumnos serán evaluados en base a ejercicios prácticos que cuentan por el 35% de la nota total y un examen final que cuenta por el 65% 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.