

Universidad Torcuato Di Tella
Departamento de Economía

Econometría
Primer Semestre de 2013

Profesor:

Martín González-Rozada (mrozada@utdt.edu)

Ayudante:

Giselle Montamat (mgiselle@hotmail.com)

Horarios:

Clases teóricas: lunes y martes de 8 a 9:40 horas. Aula A107.

Clases prácticas: lunes y miércoles de 11:40 a 13:20 horas. Aula AS1 y AS3.

DESCRIPCION DE LA MATERIA

El objetivo del curso es que los alumnos aprendan a conducir (y a criticar) estudios empíricos en economía. El curso está diseñado para que los estudiantes puedan analizar datos económicos a través de los métodos de regresión múltiple y sus generalizaciones. Estas últimas incluyen regresiones con variables discretas, regresiones con variables instrumentales, análisis de experimentos aleatorios y cuasi-experimentos y regresiones con datos panel y de series temporales.

PROGRAMA

1. **El Modelo de Regresión Lineal I.** Modelo de regresión de dos variables. Supuestos del Modelo. Estimación de los parámetros del modelo con el método de mínimos cuadrados ordinarios (OLS). Propiedades de los estimadores. Contrastes de hipótesis. Bondad del ajuste.
2. **El Modelo de Regresión Lineal II.** Modelo de regresión múltiple. Ecuaciones normales. Bondad del ajuste. Criterios generales de selección de modelos. Contrastes de hipótesis en el modelos de regresión lineal múltiple. Test del multiplicador de Lagrange. El test de Wald.
3. **Modelos de Regresión con Variables Instrumentales.** Validación interna y externa del modelo. Errores de especificación. Variables omitidas. El modelo de variables instrumentales con una variable explicativa y un instrumento. El modelo de variables instrumentales general. Mínimos cuadrados en dos etapas. Estimación e inferencia estadística.
4. **Modelos de Regresión con Errores No Esféricos.** Heterocedasticidad. Consecuencias de ignorar la heterocedasticidad. Contrastes para detectar heterocedasticidad. Corrección de la heterocedasticidad mediante el test de White.

Implicancias de la correlación serial. Errores autorregresivos de primer orden. Tests para detectar errores con autocorrelación de primer orden. Errores autorregresivos de mayor orden.

5. **VARIABLES DICOTÓMICAS.** El efecto de las variables cualitativas sobre la ordenada al origen. El efecto de las variables cualitativas sobre la pendiente. Contrastes de cambio estructural usando variables dicotómicas. Multicolinealidad. Ejemplos. Multicolinealidad perfecta. Multicolinealidad casi perfecta. Uso de variables cualitativas en la estimación de los determinantes del salario. Medición de la discriminación salarial.
6. **Modelos De Variable Dependiente Discreta.** El modelo de probabilidad lineal. Modelos Probit y Logit. Estimación de la decisión de participar en la fuerza de trabajo comparando los métodos de OLS, Probit y Logit.
7. **Modelos de Datos de Panel.** Modelos de efectos fijos y efectos aleatorios. Modelos conjuntos. Estimación e inferencia estadística. Modelos de datos de panel para dos períodos temporales.
8. **Experimentos y Cuasi-Experimentos.** Experimentos aleatorizados y efectos causales. Estimador de diferencias en diferencias. Potenciales problemas. Cuasi experimentos.
9. **Modelos de Regresión para Datos de Series Temporales.** Modelación de Box-Jenkins de procesos ARIMA. Función de autocorrelación y de autocorrelación parcial. Predicción. Determinación del orden de integración de una serie. Contrastes de raíz unitaria. Estacionariedad en tendencia versus estacionariedad en diferencias.

BIBLIOGRAFIA SUGERIDA

J.M. Wooldridge, *Introductory Econometrics*, South-Western College Publishing, 1999. Se puede conseguir una versión en castellano en CUSPIDE.

TRABAJOS PRACTICOS

Durante el curso se van a distribuir trabajos prácticos que involucran análisis empírico. El soft estadístico del curso es STATA que está disponible en el gabinete de computación. Los datos para los trabajos prácticos serán colgados en el Campus Virtual de la UTDT. Los trabajos prácticos se entregan **antes de que comience la clase** del día de la entrega. Los trabajos que se entreguen después de esa fecha tendrán un descuento del 50% de la nota que obtengan. Se puede trabajar en **grupos de no más de tres personas** para resolver los prácticos.

EVALUACION

Los alumnos serán evaluados en base a un examen parcial, un examen final y los trabajos prácticos. El puntaje final de la materia se obtendrá luego utilizando los siguientes ponderadores: trabajos prácticos, 30%, examen parcial, 25%, y examen final (45%). La nota final del curso será una letra de acuerdo a la escala oficial de la UTDT. La conversión de puntaje a nota final se hará por el método relativo de evaluación (método de la curva).