

PROGRAMA
IN709 "ECONOMETRÍA"
U.D. 10

REQUISITOS: IN540/MA34B, AD

PROFESORES: Viviana Fernández y Andrea Repetto

SEMESTRE: Otoño 2007

OBJETIVOS:

El curso tiene dos objetivos. El primero es que el alumno aprenda técnicas econométricas fundamentales y que, a través del análisis de modelos, aprenda a determinar cuáles son las herramientas más apropiadas a aplicar en cada situación. El segundo objetivo consiste en que el alumno sea capaz de aplicar en la práctica los métodos aprendidos, para lo cual se realizará una serie de trabajos aplicados.

CONTENIDOS:

I. Teoría Asintótica

1. Introducción
2. Consistencia
3. Eficiencia
4. Distribución asintótica

II. Mínimos Cuadrados Generalizados

1. Introducción
2. Heteroscedasticidad
3. Autocorrelación

III. Variables Instrumentales y Método Generalizado de Momentos

1. Introducción
2. Errores en variables
3. Identificación exacta y sobreidentificación
4. Estimación vía momentos
5. Test de validez de restricciones

IV. Modelos de Ecuaciones Simultáneas

1. Introducción
2. Identificación
3. Estimación 1: Métodos de Información Limitada
4. Estimación 2: Métodos de Información Completa

V. Datos de Panel

1. Efectos fijos y aleatorios
2. Paneles dinámicos

VI. Modelos de Variables Dependientes Discreta

1. Modelos de elección binaria: probit, logit.
2. Probit bivariado
3. Datos de conteo: modelo Poisson

VII. Modelos para Datos Censurados y Truncados

1. Regresión truncada
2. Modelo de regresión con datos censurados: Tobit
3. Sesgo de selección
4. Modelos de duración

REFERENCIAS:

Los textos principales para este curso son: B.H. Baltagi, *Econometric Analysis of Panel Data* [Wiley, 2001], W.H. Greene, *Econometric Analysis* (Prentice Hall, 2003), F. Hayashi, *Econometrics* [Princeton University Press, 2000] y J. Wooldridge, *Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data* [MIT Press, 2001]. Todos ellos se encuentran en biblioteca y abarcan todos los tópicos que estudiaremos. Las ediciones anteriores de Greene son sustitutos perfectos para efectos de este curso. También usaremos otros textos y algunos *papers* que serán referencia útil en distintos tópicos, los que serán asignados en clases. Algunos libros adicionales de utilidad son:

- Amemiya, T., *Advanced Econometrics*, Harvard University Press, 1985.
- Davidson R. y J. MacKinnon, *Estimation and Inference in Econometrics*, Oxford U. P., 1993.
- Johnston, J. y J. Di Nardo, *Econometric Methods*, McGraw Hill, 1997.
- Judge, G., R.C. Hill, W.E. Griffiths, H. Lutkepohl y T-C. Lee, *Introduction to the Theory and Practice of Econometrics*, John Wiley&Sons, 1988.
- Kennedy, P., *A Guide to Econometrics*, MIT Press, 1992.
- Wooldridge, J. *Introductory Econometrics: A Modern Approach*, South-Western, 2003.

EVALUACIÓN:

La evaluación del curso consistirá en 3 controles, con una ponderación del 15% cada uno, un examen con ponderación de 30%, y una serie de tareas con ponderación del 25%. No se borrará controles, ni tareas. Tampoco se reemplazará notas. No hay eximición. El trabajo será grupal (grupos de a dos) y consistirá en aplicar las herramientas aprendidas en el curso para estudiar una teoría económica. Los datos y preguntas estarán en la página *web* del curso con al menos una semana de anticipación (en U-cursos).

CALENDARIO DE ACTIVIDADES:

1. Tareas: Los informes deberán ser entregados impresos a Soledad Vergara (4o piso, anexo 84914), a más tardar a las 4:00 PM en las fechas a continuación. Por el primer día de atraso, se descontará 3 puntos de la nota. No se aceptará tareas con más de un día de atraso.

- a. Tarea 1: viernes 30 de marzo.
- b. Tarea 2: viernes 27 de abril.
- c. Tarea 3: lunes 28 de mayo.
- d. Tarea 4: viernes 22 de junio.

2. Controles:

- a. Control 1: viernes 13 de abril.
- b. Control 2: viernes 11 de mayo.
- c. Control 3: viernes 8 de junio.

3. Examen: En la fecha fijada por la Escuela.