

Econometría – Doctorado en Economía
Universidad Nacional de La Plata
Junio – Julio 2011

Información básica:

Profesor: Carlos Lamarche (email: lamarche@ou.edu)
 Clases: Lunes, Miércoles, Viernes de 9:00 a 12:00, aula a confirmar.
 Horarios de consulta: Lunes, Miércoles, Viernes de 12:00 a 13:00.
 Página web del curso: <http://faculty-staff.ou.edu/L/Carlos.E.Lamarche-1/ec6000/ec6000.html>

Programa Tentativo:

Clase	Día	Tópico	Bibliografía (libro y capítulo)
1	15 de Junio	Estadística Matemática: variables aleatorias, funciones de distribución y momentos.	Notas de clase, BI, DA
2	17 de Junio	Teoría de las muestras grandes: consistencia y distribución asintótica	Notas de clase, DA
3	20 de Junio	Delta method, Bootstrap y simulaciones de Monte Carlo. Estimación de Varianzas	CT 11 & 12
4	22 de Junio	Endogeneidad en modelos lineales: Variables instrumentales y Mínimos cuadrados en dos etapas.	CT 4 & 6, WO 7 & 9
5	24 de Junio	Endogeneidad en modelos no lineales: Estimación en modelos con errores clásicos y no clásicos.	CT 26, CT 4
6	1 de Julio	Método Generalizado de Momentos: Identificación, estimación y teoría asintótica.	CT 6, notas de clase
7	4 de Julio	Modelos lineales y no lineales para datos en panel. Clustering y factor models.	CT 21 & 22, HS 4, WO10 & 11, BA 3
8	6 de Julio	Quantile regression: Estimación de corte transversal y panel. Variables endógenas. Teoría asintótica.	KO, AM, CT 4.6
9	8 de Julio	Modelos no lineales y estimación de máxima verosimilitud. Estimación en muestras no aleatorias	CT 5, CT 14, CT 16, RU
10	11 de Julio	Identificación y estimación de Treatment Effects. Variables instrumentales y métodos de regression.	WO 18, CT 25
11	13 de Julio	Modelos semiparametricos y no-parametricos. Estimación y selección de parámetros	PU, CT 9
12	15 de Julio	Análisis de modelos de duración: Modelos paramétricos, semiparametricos y noparametricos. Estimación en panel.	LA 1-3, CT 17

Libros:

1. Requeridos:

1.1 Microeconometrics: Methods and Applications, Cameron and Trivedi (2005), Cambridge (CT).

1.2 Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data, Jeffrey Wooldridge (2002), MIT Press (WO).

2. Recomendados:

2.1 Stochastic limit theory, James Davidson (1994), Oxford University Press (DA)

- 2.2 Probability and Measure, Patrick Billingsley (1995), John Wiley & Sons (BI).
- 2.3 Advanced Econometrics, Takeshi Amemiya (1985), Harvard University Press (AM)
- 2.4 An Introduction to Classical Econometric Theory, Paul Ruud (2000), Oxford University Press (RU)
- 2.5 Analysis of Panel Data, Cheng Hsiao (2003), Cambridge University Press (HS).
- 2.6 Econometric Analysis of Panel Data, Badi Baltagi (2005), John Wiley & Sons (BA).
- 2.7 Quantile Regression, Roger Koenker (2005), Cambridge University Press (KO).
- 2.8 Nonparametric Econometrics, Pagan and Ullah (1999), Cambridge University Press (PU).
- 2.9 The Economic Analysis of Transition Data, Tony Lancaster (1990), Cambridge University Press (LA).