

**Econometría – Doctorado en Economía**  
**Universidad Nacional de La Plata**  
**Junio 2018**

**Información básica:**

Profesor: Carlos Lamarche (email: [clamarche@uky.edu](mailto:clamarche@uky.edu))  
 Clases: 10:30 a 13:00, aula a confirmar.  
 Horarios de consulta: Lunes, Martes y Miércoles de 13:00 a 14:00.

**Programa Tentativo:**

Clase	Día	Tópico	Bibliografía (libro y capítulo)
1	11 de Junio	Estadística Matemática: variables aleatorias, funciones de distribución y momentos. Teoría de las muestras grandes: consistencia y distribución asintótica.	Notas de clase, BI, DA
2	12 de Junio	Delta method, Bootstrap y simulaciones de Monte Carlo. Estimación de Varianzas	CT 11 & 12
3	13 de Junio	Endogeneidad en modelos lineales: Variables instrumentales y Mínimos cuadrados en dos etapas. Endogeneidad en modelos no lineales: Estimación en modelos con errores clásicos y no clásicos.	CT 4 & 6, WO 7 & 9, CT 26
4	18 de Junio	Método Generalizado de Momentos: Identificación, estimación y teoría asintótica.	CT 6, notas de clase
5	19 de Junio	Modelos lineales y no lineales para datos en panel. Clustering y factor models.	CT 21 & 22, HS 4, P, WO10 11, BA 3
6	25 de Junio	Modelos no lineales y estimación de máxima verosimilitud. Estimación en muestras no aleatorias	CT 5, CT 14, CT 16, RU
7	26 de Junio	Identificación y estimación de Treatment Effects. Variables instrumentales y métodos de regression.	WO 18, CT 25
8	27 de Junio	Quantile regression: Estimación de corte transversal y panel. Variables endógenas. Teoría asintótica. Estimación of high-dimensional models. Regularización en modelos lineales and no lineales.	KO, AM, CT 4.6, Notas de clase

**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 (2010), 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 (2014), Cambridge University Press (HS).
- 2.6 Econometric Analysis of Panel Data, Badi Baltagi (2008), John Wiley & Sons (BA).
- 2.7 Quantile Regression, Roger Koenker (2005), Cambridge University Press (KO).
- 2.8 Time Series and Panel Data Econometrics, M. Hashem Pesaran (2015), Oxford University Press (P)