

**Econometría 2023**  
**Programa de la materia**

**Profesor:** Carlos Lamarche (email: [clamarche@uky.edu](mailto:clamarche@uky.edu); página web: [carloslamarche.com](http://carloslamarche.com))

**Fechas y horarios de clases:**

- Clases presenciales: 2/06, 5/06, 12/06, 22/06 y 26/06, de 17 a 20hs.
- Horarios de consulta: a confirmar.
- Material de lectura: disponible en el aula virtual a partir de 01/06

**Programa Tentativo:**

| Clase | Día         | Tópico   | Bibliografía<br>(libro y capítulo)                    |
|-------|-------------|--|---|
| 1     | 2 de Junio  | Estadística Matemática: variables aleatorias, funciones de distribución y momentos. OLS y Regularización. Endogeneidad en modelos lineales: Variables instrumentales y Mínimos cuadrados en dos etapas. Errores de medición. | Notas de clase, DA; HA 2, 4, 12 & 29; WO 7 & 9; CT 26 |
| 2     | 5 de Junio  | Método Generalizado de Momentos: Identificación y estimación. Método de Momentos Simulados. Teoría de las muestras grandes: consistencia y distribución asintótica.  | HA 7 & 13; CT 6, notas de clase                       |
| 3     | 12 de Junio | Delta method, Bootstrap y simulaciones de Monte Carlo. Estimación de Varianzas. Clustered standard errors.   | HA 10; CT 11 & 12                                     |
| 4     | 22 de Junio | Identificación y estimación de Treatment Effects. Difference-in-Differences in linear and nonlinear models.  | HA 18 & 21; CT 25                                     |
| 4     | 22 de Junio | Modelos lineales y no lineales para datos en panel. Paneles con factores. Modelos no lineales y estimación de máxima verosimilitud. Estimación en muestras no aleatorias   | HA 17; CT 21 & 22, WO 11, HS, P                       |
| 5     | 26 de Junio | Quantile regression: Estimación de corte transversal y panel. Variables endógenas. Teoría asintótica. Estimación of high-dimensional models. Regularización.   | HA 24, KO, AM, Notas de clase                         |

**Material de lectura y videos:** En el aula virtual se puede acceder a notas de clase y videos correspondientes a cada semana.

**Libros:**

*1. Requeridos:*

- 1.1 Econometrics, Bruce Hansen (2022), Princeton University Press (HA)
- 1.2 Microeconometrics: Methods and Applications, Cameron and Trivedi (2005), Cambridge (CT).

*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 Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data, Jeffrey Wooldridge (2010), MIT Press (WO).
- 2.5 Analysis of Panel Data, Cheng Hsiao (2014), Cambridge University Press (HS).
- 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)