

## Programa Econometría II

**Profesores: María Lorena Garegnani y Gabriel V. Montes Rojas**

**JTP: Javier Ibarlucía, Laura Carella (lic.)**

**Ayudantes: Fernando Banchemo, María Belén Ragone**

### Temario

1. Revisión del modelo lineal general uniecuacional. Introducción a regresores estocásticos y a la teoría asintótica. Criterios de evaluación de modelos econométricos.
2. Series de tiempo estacionarias. El concepto de estacionariedad. Introducción a modelos autoregresivos y de promedios móviles (ARMA). Función de autocovarianza, autocorrelación y autocorrelación parcial. Ecuaciones de Yule-Walker. Pronóstico y predicción.
3. No estacionariedad en series de tiempo. Contrastes de raíces unitarias. El concepto de cointegración y los modelos de corrección al equilibrio. Modelos con tendencia y estacionalidad. Modelos de filtros.
4. Tópicos de series de tiempo. Cambios estructurales. Modelos no lineales. Introducción a modelos de heteroscedastidad condicional autoregresiva (ARCH). Introducción a la metodología de vectores autorregresivos (VAR). Causalidad en el sentido de Granger.
5. Modelos de datos en panel. Muestra longitudinal y cortes transversales agrupados. Modelos one-way y two-way. Efectos fijos, primeras diferencias y efectos aleatorios. Contraste de Hausman. Modelos anidados y clusters. Modelos de paneles dinámicos. Paneles heterogéneos.

### Bibliografía

#### Básica

- Notas de clase para Econometría. Disponibles en: <http://gabrielmontes.com.ar>
- Johnston, J. y DiNardo, J. (1997 y ediciones posteriores) Métodos de Econometría, McGraw-Hill.
- Wooldrige, J. (2009 y ediciones posteriores) Introducción a la Econometría: Un Enfoque Moderno, Cengage Learning.

#### Avanzada y de consulta

- Angrist, J.D. y Pischke, J.-S. (2009), Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion, Princeton University Press.
- Baltagi, B.H. (2013), Econometric Analysis of Panel Data (5<sup>th</sup> edn), John Wiley & Sons.
- Cameron, A. C. y Trivedi P. K. (2005). Microeconometrics: Methods and Applications,

Cambridge University Press.

- Enders, W. (2004), Applied Econometric Time Series, Wiley Economics.
- Greene W. (1993 y ediciones posteriores), Econometric Analysis , Macmillan.
- Hamilton J. (1994 y ediciones posteriores), Time Series Analysis, Princeton Univ. Press.
- Hsiao, C. (2003), Analysis of Panel Data, Cambridge University Press.
- Pesaran, M.H. (2015), Time Series and Panel Data Econometrics, Oxford University Press.
- Wooldrige, J. (2012) Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data, MIT Press: Cambridge.

### **Pautas de evaluación**

La evaluación del curso se basa en las siguientes instancias:

- Un *examen final* al final del curso que corresponde al 80% de la nota. Dada la abundancia de fórmulas y conceptos que aparecerán a lo largo del curso, se puede traer al examen una hoja tamaño carta, escrita de ambos lados, con notas de elaboración y uso personal. Es requisito ineludible para la aprobación del curso que la calificación sea superior a 4 puntos.
- 4 *Trabajos prácticos* (5% de la nota final del curso cada uno, total 20%). Estos trabajos se basan en ejercicios teóricos, aplicaciones empíricas y análisis de trabajos recientes. Los trabajos prácticos deben ser elaborados en equipos de *dos o tres personas*.
- Esta materia no tiene promoción. Sin embargo, si el promedio entre el final y los TPs está entre 7 y 10 se les dará por aprobada la materia; si se sacan entre 4 y 6, en la mesa de diciembre les tomaremos un coloquio; y si el promedio es menor a 4 tienen que rendir el final como libre. Si el examen final tiene nota menor a 4 tiene que rendir como libre.