



Aprobado por resol 415, fecha 04/04/2013

PROGRAMA
Métodos Cuantitativos
Edición 2013
Plan 2009
Ciclo Avanzado

1. **Docentes:** Graciela Sanroman, Carlos Casacuberta y Gastón Carracelas
2. **Créditos:** 10
3. **Carga horaria:** 50
4. **Modalidad de enseñanza:** Taller
5. **Conocimientos previos recomendados¹:** Los participantes del curso deberán poseer conocimientos de Estadística y Matemática.
6. **Objetivos:** El objetivo principal del curso es que los estudiantes adquieran las habilidades comprender la utilidad de modelos econométricos simples, estén en condiciones de estimarlos, interpretar los resultados y entender las principales limitaciones de los mismos.
7. **Contenidos:** El curso abordará el estudio de las herramientas econométricas orientadas al análisis aplicado. El curso se focalizará en el modelo de regresión lineal general: interpretación, estimación, inferencia, predicción. Se abordarán también los modelos de probabilidad para el caso de variables dependientes binarias (Modelo de Probabilidad Lineal, Probit, Logit). Finalmente, se presentarán de forma sintética los problemas más habituales que surgen al realizar inferencia (endogeneidad, no estacionariedad). El temario detallado es:

Tema 1: Introducción

- 1.1 Introducción
- 1.2 Esperanza y varianza. Definición y propiedades
- 1.3 Esperanzas condicionales y predictores lineales.
- 1.4 Varianza condicional.
- 1.5 Independencia y ausencia de correlación.

Tema 2: Modelo de regresión lineal con regresores independientes

- 2.1 Supuestos
- 2.2 Estimación de los coeficientes. Propiedades en muestras finitas y asintóticas.
- 2.3 Efectos parciales: interpretación
- 2.4 Estimación de la matriz de varianzas y covarianzas.
- 2.5 Inferencia y predicción

¹ Sin perjuicio del régimen de previas vigentes para cada Licenciatura.

2.6 Algunos contrastes de especificación

Tema 3: Modelos de Variable dependiente Binaria

3.1 MPL

3.2 Probit y Logit

Tema 4: Problemas de especificación

4.1 Datos de corte transversal (errores de medida y omisión de variables relevantes)

4.2 Series temporales (no estacionariedad de las series)

8. **Método de trabajo:** Se realizará en la modalidad de taller. En el curso se abordarán los temas teóricos con un nivel básico y en cada tema se realizará una instancia de taller en la que se reproducirán e interpretarán los resultados empíricos de artículos o ejemplos seleccionados con ese fin. El software a utilizar será el STATA.

9. Sistema de evaluación

La evaluación del curso será mediante la realización de 4 ejercicios domiciliarios (con un puntaje de 10 puntos cada uno) y un trabajo final (con un puntaje de 60 puntos).

Los estudiantes que alcancen una nota mínima de 3 en cada ejercicio y en el trabajo final y obtengan un promedio de 9 o más en total quedarán exonerados de presentar del examen final.

Aquellos estudiantes que alcancen el mínimo en cada domiciliario y en el trabajo final y obtengan un promedio en el total entre 3 y 8 podrán rendir un examen reglamentado. Para reglamentar o promover los estudiantes deber registrar 75% de asistencias.

Quienes no cumplan con los requisitos anteriores podrán rendir el examen libre.

10. Bibliografía

Obligatoria

Wooldridge, J. M. (2001) Introducción a la Econometría: un enfoque moderno, Thomson Learning, México. (1a. Edición en español, 2007).

Ampliatoria

Cameron A. C. y P.K. Trivedi (2009): Microeconometrics Using Stata, Stata Press.

Greene, W. H. (1999), Análisis Econométrico. 3a. Edición. Prentice Hall Iberia, Madrid

Versión:

Fecha aprobado:

Resolución: