

## **1. Identificación de la asignatura**

**División:** Humanidades y Ciencias Sociales

**Departamento:** Economía

**Nombre de la asignatura:** Econometría

**Código de la asignatura:** ECO64021

**Nivel de la asignatura (Pregrado, Postgrado):** Postgrado

**Requisitos (Código y nombre de la asignatura):** Ninguno

**Número de créditos de la asignatura:** 3

**No. de horas teóricas:** 36 Horas

**No. de horas prácticas:** N/A

**No. de horas tutoriales:** N/A

**Idioma de la asignatura:** Español  
(Español, Inglés, Alemán, francés, otros)

**Modalidad de la asignatura:** Presencial  
(Presencial, Virtual, Híbrido, otros)

## **2. Descripción de la asignatura.**

En esta asignatura se presentan métodos econométricos avanzados frecuentemente utilizados para modelar el comportamiento de los agentes económicos individuales. Se cubrirán aspectos analíticos, conceptuales y empíricos en igual proporción. Se espera que al finalizar el curso, los alumnos sean capaces de realizar aplicaciones en diferentes campos del ámbito económico como la economía laboral, la economía del transporte, la economía de la salud entre otros.

## **3. Justificación.**

El curso de econometría se enmarca en el conjunto de cursos doctorales que profundiza en la apropiación del instrumental necesario para el desarrollo de explicaciones económicas desde una perspectiva cuantitativa.

## **4. Objetivo general de la asignatura.**

Esta asignatura se orientará a:

Proporcionar a los estudiantes los conceptos teóricos y prácticos necesarios para la estimación e interpretación de modelo aplicados al comportamiento de los agentes económicos individuales.

## **5. Resultados de Aprendizaje u Objetivos Específicos:**

Al finalizar la asignatura, los estudiantes deben estar en capacidad de:

- Familiarizar a los estudiantes con la econometría utilizada para estimar modelos microeconómicos.
- Desarrollar en los estudiantes las habilidades necesarias para la conceptualización y estimación de un problema de microeconomía aplicada

## **6. Temas de la asignatura.**

- Introducción a la teoría asintótica y el método delta
- Repaso Modelo Clásico de Regresión Lineal y supuestos.
- Pruebas de hipótesis, problemas de endogeneidad y variable omitida, sesgo de selección, doble causalidad y error de medición.
- Estimación por variables instrumentales y mínimos cuadrados en dos etapas
- Modelos de elección discreta:
  - MPL, logit y probit
  - logit y probit multinomial
  - Probit bivariado y probit ordenado.
- Modelos para datos de panel:
  - Efectos fijos y efectos aleatorios
  - Introducción a modelos con variable dependiente rezagada
- Variable dependiente limitada, truncamiento y datos censurados.

## **7. Bibliografía Básica de la asignatura.**

### **Principal**

Greene, William (2003). Econometric Analysis. Pearson Education. Fifth edition. Gr

Wooldridge, Jeffrey (2010). Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data. The MIT Press. W2

### **Bibliografía complementaria**

Amemiya T. (1985), Advanced Econometrics, Basil Blackwell.

Anderson, T. y C. Hsiao (1982): "Formulation and estimation of dynamic models using panel data", *Journal of Econometrics*, 18, 67-82.

Arellano, M. y S. Bond (1991): "Some tests of specification for panel data: Montecarlo evidence and an application to employment equations", *Review of Economics Studies*, 58, 277-297.

Blundell, R. y C. Meghir (1987): "Bivariate alternatives to the Tobit model", *Journal of Econometrics*, 34, 179-200.

Cameron, A. C. y Trivedi P. K. (2005). *Microeconometrics: Methods and Applications Regression Analysis of Count Data*, (Cambridge University Press).

Cheser, A. and M. Irish (1987): "Residual analysis in the grouped data and censored normal linear model", *Journal of Econometrics*, 34, 33-62.

Cogan, J.F. (1981): "Fixed costs and labour supply", *Econometrica*, 49, 945-964.

Elbers, C. y G. Ridder (1982): "True and spurious duration dependence: the identifiability of the proportional hazard models", *Review of Economic Studies*, 49, 402-411.

Heckman, J., (1979): "Sample selection bias as a specification error", *Econometrica*, 47, 153-161.

Heckman, J. y B. Singer (1984): "Econometric analysis of longitudinal data", *Handbook of Econometrics*, vol. 3, Griliches & Intriligator (Eds.).

Kiefer, N. (1991): "Economic duration data and hazard functions", *Journal of Economic Literature*, 16, 646-675.

Lancaster, T. (1979): "Econometric models for the duration of unemployment", *Econometrica*, 47, 939-956.

Maddala G.S. (1986), *Limited Dependent and Qualitative Variables in Econometrics*, Cambridge University Press.

McFadden, D. (1973): "Conditional Logit analysis of quantitative choice behaviour", in *Frontiers in econometrics*, P. Zarembka (Eds.), Academic Press, New York.

Meyer, B. (1990): "Unemployment insurance and unemployment spells", *Econometrica*, 58, 757-782.

Mroz, T.A. (1987): "The sensitivity of an empirical model of married women's hour of work to economic and statistical assumptions", *Econometrica*, 55, 765-800.

Nickell, S. (1979): "Estimating the probability of leaving unemployment", *Econometrica*, 47, 1249-1266.

Silverman, B.W. (1986): "Density estimation for statistics and data analysis", Chapman and Hall Capítulos 2 y 4.