



<b>DENOMINACIÓN ASIGNATURA: Econometría Avanzada</b>		
<b>GRADO: Economía</b>	<b>CURSO:2013</b>	<b>CUATRIMESTRE:2nd</b>

<b>PLANIFICACIÓN SEMANAL DE LA ASIGNATURA</b>								
SE- MA- NA	SE- SIÓN	DESCRIPCIÓN DEL CONTENIDO DE LA SESIÓN	GRUPO (Marcar X)		Indicar espacio necesario distinto aula (aula inform, audiovisual etc..)	TRABAJO DEL ALUMNO DURANTE LA SEMANA		
			GRA N- DE	PE- QUE- ÑO		DESCRIPCIÓN	HORAS PRESEN CIALES	HORAS TRABJO Semana Máximo 7 H
1	1	<u>Las relaciones causales y efectos parciales</u> : las expectativas condicionales, las proyecciones lineales y efectos parciales. Elasticidades y semi-elasticidades. Modelos lineales vs modelos no lineales.	X			Leer Wooldridge cap. 1 y 2.	1,5	
1	2	<u>Ejercicios</u> : Propiedades de las expectativas condicionales y proyecciones lineales. Interpretación de los efectos parciales en los modelos lineales y no lineales. Promedio de los efectos parciales.		X		Entregar Práctica 1.	1,5	
2	3	<u>Teoría asintótica básica 1</u> : Convergencia en probabilidad y en distribución. Ley de los Grandes Números y Teoremas Centrales del Límite.	X			Leer Wooldridge secciones 3.1, 3.2, 3.3. y 3.4. y Hayashi sección 2.1.	1,5	
2	4	<u>Ejercicios</u> : Aplicaciones de los teoremas de Slutsky y mapa continuo. Consistencia y distribución asintótica de los momentos muestrales.		X		Entregar Practica 2.	1,5	
3	5	<u>Teoría asintótica básica 2</u> : El principio de analogía. Estimadores CAN. El método delta.	X			Leer Wooldridge sección 3.5.	1,5	
3	6	<u>Ejercicios</u> : Distribución asintótica de las funciones de la medias muestrales. Aplicaciones del método delta.		X		Entregar Práctica 3.	1,5	
4	7	<u>Mínimos Cuadrados en el modelo lineal uniecuacional 1</u> : MCO, MCG y cuasi-máxima verosimilitud. Consistencia y normalidad asintótica en condiciones clásicas y no estándar.	X			Leer: Wooldridge secciones 4.1, 4.2.1, 4.2.2. Hayashi secciones 2.3.	1,5	
4	8	<u>Ejercicios</u> : Eficiencia asintótica del MCG y ML. Regresores con tendencia.		X		Entregar Práctica 4.	1,5	
5	9	<u>Mínimos Cuadrados en el modelo lineal uniecuacional 2</u> : Regresión segmentada. Variables omitidas, variables proxy y errores de medida.				Leer Wooldridge 4.3 y 4.4.	1,5	
5	10	<u>Ejercicios</u> : Sesgo asintótico debido a variables omitidas y errores de medición.				Entregar Práctica 5	1,5	
6	11	<u>Mínimos Cuadrados en el modelo lineal uniecuacional 3</u> . Estimación consistente de la covarianza y varianza asintótica condiciones estándares y no estándares. Intervalo de confianza.	X			Leer Wooldridge secciones 4.3 y 4.4. Hayashi sección 2.5.	1,5	7H

6	12	Ejercicios: estimadores de la varianza residual. Inferencia asintótica cuando las innovaciones tienen autocorrelación de forma desconocida.				Entregar Práctica 6.	1,5	
7	13	Contrastando restricciones lineales en los parámetros en el modelo uniecuacional 1: Restricciones lineales y mínimos cuadrados restringidos. Consistencia, poder asintótico, alternativas locales y eficiencia. Contraste de Wald.	X			Leer Hayashi sección 2.4. Wooldridge 4.2.3	1,5	7H
7	14	Ejercicios: Derivación de la distribución asintótica de los mínimos cuadrados restringidos. Derivación de la distribución asintótica del contraste de Wald en alternativas locales.		X		Entregar Práctica 7.	1,5	
8	15	Contrastando restricciones lineales en los parámetros en el modelo uniecuacional 2: Razón de verosimilitudes y Multiplicador de Lagrange. Contrastes para homocedasticidad y ausencia de autocorrelación.	X			Leer Wooldridge 3.5.2, 4.2.4 y 6.2.4. Hayashi 2.4, 2.6, y 3.7.	1,5	7H
8	16	Ejercicios: Comparación entre los contrastes.		X		Entregar Práctica 8.	1,5	
9	17	<b>EXÁMENES PARCIALES</b>	X			<b>EXÁMENES PARCIALES</b>	1,5	7H
9	18	Estimación de variables instrumentales en el modelo lineal uniecuacional 1: Identificación y instrumentos. Condiciones de orden y de Rank. Consistencia y normalidad asintótica del MC2E...		X		Leer Hayashi 3.1, 3.2 y 3.3. Wooldridge 5.1, 5.2.1 y 5.2.2.	1,5	
10	19	Ejercicios: Distribución asintótica del MC2E en condiciones no estándares. Estimador de la varianza asintótica.		X		Entregar Práctica 9.	1,5	
10	20	Estimación de variables instrumentales en el modelo lineal uniecuacional 2: Inferencia con MC2E. Instrumento débil y problemas de eficiencia. Contrastes de endogeneidad y restricciones de sobreidentificación.	X			Leer Wooldridge 5.2.3, 5.2.4, 5.2.5 and 5.2.6.	1,5	
11	21	Ejercicios: Eficiencia asintótica del MC2E. Implementación del contraste de endogeneidad y restricciones de sobreidentificación.		X		Entregar Práctica 10.	1,5	
11	22	Sistemas de ecuaciones lineales 1: MCO y MCG en modelos SUR. MCG factibles. Contrastando restricciones en las ecuaciones.	X			Leer Wooldridge 7.	1,5	
12	23	Ejercicios: Eficiencia en modelos SUR. Inferencia en modelos SUR. Ejercicios: Programar MCG en un modelo SUR utilizando R.		X		Entregar Práctica 11.	1,5	
12	24	Sistemas de ecuaciones lineales 2: Identificación en modelos de ecuaciones simultáneas con restricciones de exclusión y generales. MC2E ecuación por ecuación. MC2E vs MC3E.	X			Leer Wooldridge 8, 9.1, 9.2, 9.4. and 9.5. Hayashi 4.1, 4.2, 4.3, 4.4 y 4.5.	1,5	
13	25	Ejercicios: Distribución asintótica del MC3E. Contrastes en restricciones lineales.		X		Entregar Práctica 12.	1,5	
13	26	Estimadores Extremos 1: Máxima verosimilitud condicionada, mínimos cuadrados no lineales, GMM. Identificación. Propiedades asintóticas del los estimadores extremos.	X			Leer Wooldridge 12.1, 12.2, 12.3. Hayashi 7.1, 7.2 y 7.3.	1,5	
14	27	Ejercicios: Ejemplos de modelos con variable dependiente limitada. Logit, Tobit y Conteo.		X		Entregar Práctica 13.	1,5	
14	28	Estimadores Extremos 2: Algoritmos de optimización numérica.	X			Hayashi 7.5.	1,5	
<b>SUBTOTAL</b>							<b>42 + 68 = 110</b>	
15		Recuperaciones, tutorías, entrega de trabajos, etc					1,5	
16-18		Preparación de evaluación y evaluación					3	
<b>TOTAL</b>							<b>150</b>	

