



FACULTAD  
DE CIENCIAS  
ECONÓMICAS



18º Ord.  
EXP-UNC:0055221/2017

## **RESOLUCIÓN N° 521**

VISTO:

El programa del curso optativo de formación específica “Datos de Panel”, elevado por la Dirección de la Carrera de Doctorado de Ciencias Económicas para la Mención en Economía, correspondiente el ciclo lectivo 2017;

Y CONSIDERANDO:

Que se eleva en un todo de acuerdo a lo reglamentado por el inc. 10) del Art. 31 de los Estatutos de la Universidad Nacional de Córdoba;

Que el mismo fue avalado en la 6º Reunión del Consejo de Doctorado en Ciencias Económicas del 11 de octubre de 2017; por ello,

EL HONORABLE CONSEJO DIRECTIVO DE LA  
FACULTAD DE CIENCIAS ECONÓMICAS

**RESUELVE:**

Art. 1º.- Aprobar el programa del curso optativo de formación específica “Datos de Panel”, correspondiente al ciclo lectivo 2017, para la Carrera de Doctorado en Ciencias Económicas, Mención en Economía, que forma parte integrante de la presente.

Art. 2º.- Comuníquese y archívese.

DADA EN LA SALA DE SESIONES DEL HONORABLE CONSEJO DIRECTIVO DE LA FACULTAD DE CIENCIAS ECONÓMICAS DE LA UNIVERSIDAD NACIONAL DE CÓRDOBA, A ONCE DÍAS DEL MES DE DICIEMBRE DEL AÑO DOS MIL DIECISIETE.

AM




---

**Planificación de actividades académicas**


---

<b>Carrera:</b>	<b>Doctorado en Ciencias Económicas. Mención Economía</b>	
<b>Materia:</b>	Datos de Panel	
<b>Año:</b>	2017	
<b>Profesor responsable:</b>	Dr. Ricardo Descalzi	
<b>Profesor colaborador:</b>		

<b>Caracterización de la actividad curricular</b>	El curso pretende proporcionar conocimientos acerca de la formulación y estimación de modelos econométricos mediante la aplicación de las principales metodologías disponibles. En tal sentido, se expondrán los conceptos formales y las estrategias llevadas a cabo para obtener las estimaciones respectivas.
---	--

<b>Fundamentación y vinculación con los objetivos de la carrera</b>	La materia apunta a realizar una descripción de las diferentes metodologías existentes para la estimación de los modelos econométricos. Esto abarca el abordaje tanto de la teoría como también la descripción más detallada posible de los criterios utilizados al momento de resolver los problemas inherentes a la estimación de los modelos. Esto brinda un conjunto de herramientas útiles para que los alumnos consideren plausibles de ser aplicadas tanto en su labor diaria como en sus tesis finales de doctorado.
---	--

<b>Objetivos generales</b>	Familiarizar a los alumnos con la formulación y estimación de los diferentes modelos econométricos. Presentar aplicaciones de la literatura a importantes problemas de forma tal que los resultados provean herramientas para el diseño y evaluación de políticas públicas.
----------------------------	--

<b>Objetivos específicos</b>	<b>Conocimientos a alcanzar</b>
	Establecer pautas y criterios para el diseño y estimación de modelos econométricos. Interpretar los resultados obtenidos en los problemas abordados.
	<b>Capacidades a promover</b>
	Que los alumnos adquieran habilidades y destrezas en el uso de fuentes de datos y software disponibles.

<b>Contenido de la actividad curricular:</b>	
<b>Módulo/ Unidad</b>	<b>Programa Analítico</b>
1	<p><b>Modelo lineal generalizado con variables aleatorias.</b></p> <p>El rol de las expectativas condicionadas en la econometría. Características de las expectativas condicionadas. Proyecciones lineales. Modelo lineal básico con regresores aleatorios. Estimación por mínimos cuadrados ordinarios. Propiedades asintóticas de los estimadores. Soluciones al problema de las variables omitidas. Propiedades de los estimadores de mínimos cuadrados bajo errores de medición.</p>
2	<p><b>Estimación de Sistemas de Ecuaciones por OLS y GLS</b></p> <p>Estimación OLS de un sistema lineal multivariado. Mínimos cuadrados generalizados (GLS). Mínimos cuadrados generalizados factibles (FGLS). Propiedades asintóticas. Test de hipótesis múltiples. Ecuaciones de regresión aparentemente no relacionadas (SUR). Comparación entre las estimaciones OLS y FGLS en el contexto de de un sistema SUR.</p>
3	<p><b>Datos de panel: efectos fijo y aleatorios</b></p> <p>El modelo con efectos no observados. Estimación por mínimos cuadrados generalizados factibles y estimación por efectos aleatorios. La regresión con variable <i>dummy</i>. Correlación serial y el estimador de la matriz de covarianzas robusta. El apartamiento de la condición de exogeneidad estricta y la estimación por efectos fijos. La relación entre los estimadores de efectos fijos y efectos aleatorios. El test de Hausman.</p>
4	<p><b>Modelos dinámicos de datos de panel</b></p> <p>Modelos de efectos no observados sin el supuesto de exogeneidad estricta. Modelos con restricción secuencial de momentos. Modelos con variables explicativas exógenas y secuencialmente exógenas. Modelos con correlación contemporánea entre algunas variables explicativas y el error idiosincrásico. Modelos con pendientes individuales y específicas. El enfoque de método generalizado de momentos para abordar el modelo con efectos no observados. Modelos del tipo de Hausman y Taylor.</p>

<b>Bibliografía de la actividad curricular::</b>	
<b>Módulo/ Unidad</b>	<b>Material Bibliográfico de Lectura Obligatoria</b>
1	<p>Jeffrey M. Wooldridge: Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data First (1st) Edition – January 1, 2001. MIT Press. Capítulo 1, 2 y 4. Arellano, M. (2003). Panel data econometrics. Oxford university press. Capítulo 1.</p>
2	<p>Arellano, M. (2003). Capítulo 2. Wooldridge J. (2001). Capítulo 7.</p>
3	<p>Arellano, M. (2003). Capítulo 3 Wooldridge J. (2001). Capítulo 10.</p>
4	<p>Siddiqui, D. A., &amp; Ahmed, Q. M. (2013). The effect of institutions on economic growth: A global analysis based on GMM dynamic panel estimation. Structural Change and Economic Dynamics, 24, 18-33. Arellano, M. (2003). Capítulos 7 y 8 Wooldridge J. (2001). Capítulo 11.</p>

<b>Módulo/ Unidad</b>	<b>Material Bibliográfico de Lectura Optativa</b>
1	Baltagi, B. (2013). Econometric analysis of panel data. John Wiley & Sons. Capítulo 1. Hsiao, C. (2014). Analysis of panel data (No. 54). Cambridge university press. Johnston, J. (1987). Métodos de econometría. Barcelona: Vicens-Vives. Maddala G.S. (1996). Introducción a la Econometría. (Segunda ed.). México: Prentice Hall Hispanoamericana.
2	Arellano, M. (2003). Panel data econometrics. Oxford university press. Baltagi, B. (2013). Econometric analysis of panel data. John Wiley & Sons. Capítulo 2. Hsiao, C. (2014). Analysis of panel data (No. 54). Cambridge university press. Johnston, J. (1987). Métodos de econometría. Barcelona: Vicens-Vives. Maddala G.S. (1996). Introducción a la Econometría. (Segunda ed.). México: Prentice Hall Hispanoamericana.
3	Arellano, M. (2003). Panel data econometrics. Oxford university press. Baltagi, B. (2013). Econometric analysis of panel data. John Wiley & Sons. Capítulos 2, 3 y 4. Hsiao, C. (2014). Analysis of panel data (No. 54). Cambridge university press. Johnston, J. (1987). Métodos de econometría. Barcelona: Vicens-Vives. Maddala G.S. (1996). Introducción a la Econometría. (Segunda ed.). México: Prentice Hall Hispanoamericana.
4	Arellano, M. (2003). Panel data econometrics. Oxford university press. Arellano, M., & Bond, S. (1991). Some tests of specification for panel data: Monte Carlo evidence and an application to employment equations. The review of economic studies, 58(2), 277-297. Baltagi, B. (2013). Econometric analysis of panel data. John Wiley & Sons. Capítulo 8. Hsiao, C. (2014). Analysis of panel data (No. 54). Cambridge university press. Johnston, J. (1987). Métodos de econometría. Barcelona: Vicens-Vives. Maddala G.S. (1996). Introducción a la Econometría. (Segunda ed.). México: Prentice Hall Hispanoamericana. Kruiniger, H. (2009). GMM estimation and inference in dynamic panel data models with persistent data. Econometric Theory, 25(5), 1348-1391.

<b>Estrategias Metodológicas</b>	<b>Modalidad de cursado:</b>  Cada tema será discutido en una sesión (cinco sesiones en total), en la primera parte se abordará la parte teórica y luego la aplicación correspondiente. Se discutirán los resultados obtenidos y se analizarán los mismos.
	<b>Consultas:</b>  Vía Mail o Plataforma virtual.

<b>Recursos Técnicos</b>	Plataforma Moodle, sala, cañón y PC
------------------------------	-------------------------------------

<b>Evaluaciones</b>	<b>Modalidad <sup>(2)</sup>:</b> Realización de trabajos - Examen escrito.
	<b>Fechas estimadas:</b> 21 de diciembre 2017
	<b>Actividades:</b> Se distribuirán ejercicios para realizar en computadora así como también se encargará la realización de algunos ensayos, cuya ponderación será de 50% de la nota final. El examen final asumirá la modalidad de examen escrito, no presencial, que también tendrá un 50% de ponderación para la nota final.
	<b>Criterios de regularización:</b> Asistencia al 75% de las clases.
	<b>Otros:</b> -----

<sup>(2)</sup> Aclarar si serán coloquios orales o trabajos escritos, trabajos individuales o grupales, trabajo de campo, cuestionarios opciones múltiples o a desarrollar, etc.

	<b>Fechas</b>	<b>Módulo</b>
<b>Cronograma de la actividad curricular</b>	Lunes 11 de diciembre de 2017	1
	Martes 12 de diciembre de 2017	2
	Miércoles 13 de diciembre de 2017	3
	Jueves 14 de diciembre de 2017	3, 4
	Viernes 15 de diciembre de 2017	4

<b>Carga horaria de la actividad curricular</b>	<b>Carga horaria teórica: 75%</b>
	<b>Carga horaria práctica: 25%</b>

<b>Información de/ los Docente/s - Datos de Contacto:</b>	
<b>Apellido y Nombres</b>	DESCALZI, Ricardo
<b>E-mail</b>	ricdes@eco.uncor.edu

\_\_\_\_\_  
**Firma del docente responsable**