

**Licenciatura en Economía
Econometría III
Agosto-Diciembre 2021**

Profesora: Laura Juárez González (oficina #4507; laura.juarez@colmex.mx)

Atención a alumnos: Mediante solicitud de cita por correo electrónico.

Horario de clase: Martes y Jueves 11:30 – 13:00 hrs. en línea por MS Teams (hasta nuevo aviso).

Laboratorio: Jueves 7:00 a 8:30 hrs. con Yunuen Rodríguez (ynrodriguez@colmex.mx) en línea por MS Teams (hasta nuevo aviso).

Libros de texto:

(W) Wooldridge, J.M., “Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data”, MIT Press 2nd ed. 2010

(AP) Angrist, J. D. and S. Pischke. “Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion.” Princeton, N.J.: Princeton University Press, c2009. xiii, 373 p.

Otros libros de apoyo:

Cameron, A. C. and P.K. Trivedi, “Microeconometrics: Methods and Applications”. New York, N.Y.: Cambridge University, 2005. xxii, 1034 p.

Cameron, A.C. y Trivedi, P.K., “Microeconometrics using Stata”, College Station, TX: Stata Press, 2009.

Descripción del curso: El objetivo es proporcionar a los alumnos las bases teóricas y el conocimiento práctico de algunas herramientas de microeconometría que les permitan verificar hipótesis y responder preguntas de interés, dado el tipo de datos disponibles y sus limitaciones. La parte teórica del curso tratará de las ventajas, propiedades y limitaciones de cada método de estimación, y así como la interpretación de resultados. La parte práctica consistirá en aplicar los métodos a datos reales usando el paquete Stata.

Las lecturas estarán disponibles en Moodle. Las tareas y otros materiales del curso estarán disponibles en el OneDrive institucional de El Colegio.

Evaluación:

Participación en clase	10%
Presentación de un artículo de las lecturas	10%
Examen parcial	25%
Propuesta de proyecto empírico	15%
Examen final	40%

Indicaciones generales para las clases en línea:

- No está permitido a ningún participante grabar la clase. Las notas de cada clase, las cuales son complemento y no sustituto de las notas propias de cada quien, estarán disponibles para consulta.

- No se usará el chat durante la clase. Sólo se usará para poner avisos, enviar vínculos o información, al final de la clase.
- Favor de tener sus micrófonos y video cerrados durante la clase, excepto cuando quieran hacer una pregunta o participar, lo cual podrán hacer libremente en cualquier momento, de viva voz.

Estas indicaciones son para cuidar el desarrollo ordenado de las clases en línea y favorecer nuestra concentración. Conforme avance el curso, podremos ajustarlas o agregar otras, siempre con el ánimo de mejorar nuestra experiencia en línea.

Asistencia y participación en clase: Se tomará asistencia cada clase. Durante la clase, haré algunas preguntas. Quien responda de forma voluntaria y correcta, tendrá 2 puntos. Si nadie se ofrece voluntariamente a responder, yo le pediré a alguien específico que lo haga; si responde correctamente, tendrá 1 punto. Si la persona no está en clase cuando se le pide responder, o no responde correctamente, tendrá cero puntos en esa oportunidad de participar. Las/los participantes pueden preguntar todas las dudas que tengan sobre el material de forma libre, durante la clase. Estas preguntas no contarán como participación para la evaluación.

Laboratorio: Es parte integral de la clase y tiene como objetivo apoyarlos en el aprendizaje de Stata, el cual se evaluará en los exámenes. No se podrá cambiar ninguna sesión del laboratorio a petición del grupo. La única excepción es cuando haya un evento o compromiso académico oficial del CEE o de El Colegio (por ejemplo, examen de otra clase) en el mismo día y a la misma hora del laboratorio. En este caso, deberán pedir el cambio con anticipación directamente conmigo, no con el laboratorista. No se tomará asistencia a las sesiones; cada una se impartirá, conforme a lo previsto, con la asistencia mínima de un/a estudiante. Si nadie del grupo se presenta a tomar alguna sesión, ésta se dará por vista y no se repondrá. Si esto sucede en dos ocasiones, se cancelará el laboratorio y el grupo deberá hacer las tareas y cubrir los conocimientos de Stata por su cuenta.

Presentación: Cada alumna/o deberá presentar en 15 minutos uno de los artículos de la lista de lecturas y enviarme el archivo de su presentación por correo. Las fechas se asignarán conforme avance el curso.

Exámenes: Tanto el examen parcial como el final cubrirán teoría y práctica de los métodos vistos y los artículos de las presentaciones. Se evaluará que el alumnado aplique los métodos vistos en clase usando datos reales y el paquete Stata, que sea capaz de interpretar sus resultados y de describir, con palabras y con las ecuaciones relevantes, las propiedades y limitaciones del método usado. Si un/a estudiante no se presenta al examen parcial, el porcentaje de ese examen se asignará al examen final, el cual cubrirá todos los temas del curso. Los exámenes se realizarán en línea hasta nuevo aviso.

Propuesta de proyecto empírico: Cada alumna/o deberá presentar una propuesta que explique la pregunta de investigación que se desea responder, por qué es relevante, cuál es la literatura previa al respecto, así como los datos y método econométrico que usará para responderla. Es obligatorio usar una técnica de estimación cubierta en el curso. La primera

entrega será el 17 de septiembre para recibir comentarios. La entrega final, con los comentarios incorporados, deberá ser entregada al final del curso.

Sólo se aplicarán exámenes finales extemporáneos por motivos graves y debidamente justificados ante la Coordinación de la Licenciatura en Economía. No se permitirá sustituir los aspectos de evaluación descritos en este temario, ni sus ponderaciones, por otros diferentes o adicionales.

Todo acto de deshonestidad académica constituye una falta grave y, como tal, derivará en la no acreditación de la materia. Adicionalmente, el caso será sometido a la consideración de la Junta de Profesores del Centro de Estudios Económicos.

Temas*

I.	Causalidad e Identificación (introducción)	(AP): Cap. 1 y 2
II.	Modelo causal de Rubin	Cap. 21 (21.1-21.3)
III.	Breve repaso de regresión lineal múltiple	Cap.2-4
IV.	Diferencias-en-diferencias (DD, DDD)	Cap 6 (6.5) (AP): Cap 5 (5.2)
V.	Variables instrumentales (IV) y LATE	Cap. 5 y 6
VI.	Regresión Discontinua (RDD)	Cap. 21 (21.5) (AP): Cap. 6
VII.	Sistemas de ecuaciones (SE, SUR)	Cap. 7 y 9
VIII.	Modelos lineales para datos de panel	Cap. 10
IX.	Controles sintéticos	
X.	Modelos de elección discreta: LPM, probit, logit	Cap. 13 (13.1-13.7), 15
XI.	Datos de conteo	Cap. 19
XII.	Soluciones de esquina: Tobit	Cap. 16
XIII.	Auto-selección muestral	Cap. 17

Lista de Lecturas

Los artículos marcados con (*) son teóricos o de consulta, y NO para las presentaciones en clase.

Causalidad e Identificación

*Glennerster, Rachel, and Kudzai Takavarasha. *Running Randomized Evaluations: A Practical Guide*. Princeton: Princeton University Press, 2013. Cap. 2, págs. 24-65.

Diferencias-en-diferencias (DD)

*Bertrand, M., Duflo, E. and Mullainathan, S., "How Much Should We Trust Differences-in-Differences Estimates?" *Quarterly Journal of Economics*, vol. 119 no.1 (February 2004), pp. 249-275.

* Todos los capítulos en la lista de temas se refieren al libro (W), excepto donde se indica (AP).

Chen, Yi, Ziyang Fan, Xiaomin Gu, and Li-An Zhou. 2020. "Arrival of Young Talent: The Send-Down Movement and Rural Education in China." *American Economic Review*, 110 (11): 3393-3430. DOI: 10.1257/aer.20191414

Hanna, Rema and Paulina Oliva. 2015. "The effect of pollution on labor supply: Evidence from a natural experiment in Mexico City." *Journal of Public Economics*, Volume 122, 2015, Pages 68-79.

Variables Instrumentales (IV)

*Angrist, Joshua D., Guido W. Imbens and Donald B. Rubin (1996), "Identification of Causal Effects Using Instrumental Variables," *Journal of the American Statistical Association*, 91(434):444-455.

*Angrist, Joshua D. and Alan B. Krueger (2001), "Instrumental Variables and the Search for Identification: From Supply and Demand to Natural Experiments," *Journal of Economic Perspectives*, 13(2):69-85. (<http://www.nber.org/papers/w8456>)

Sarsons, H. (2015). Rainfall and conflict: A cautionary tale. *Journal of Development Economics*, 115, 62–72. <https://doi.org/10.1016/j.jdeveco.2014.12.007>

Bingley, P., Lundborg, P., & Lyk-Jensen, S. V. (2020). The Opportunity Costs of Mandatory Military Service: Evidence from a Draft Lottery. *Journal of Labor Economics*, 38(1), 39–66. <https://doi.org/10.1086/704495>

Sistemas de Ecuaciones

Miguel, E., Satyanath, S. y Sergenti, E., "Economic Shocks and Civil Conflict: An Instrumental Variables Approach," *Journal of Political Economy*, vol. 112(4), pp. 725-753, August 2004.

Datos de Panel

Reuven Glick and Alan M. Taylor, "Collateral Damage: Trade Disruption and the Economic Impact of War", *Review of Economics and Statistics*, 2010, 92:1, 102-127

Regresión Discontinua (RDD)

*Lee, D. S., and T. Lemieux. "Regression Discontinuity Designs in Economics." *Journal of Economic Literature* 48, no. 2 (2010): 281-355.

Del Valle, Alejandro, Alain de Janvry, and Elisabeth Sadoulet. 2020. "Rules for Recovery: Impact of Indexed Disaster Funds on Shock Coping in Mexico." *American Economic Journal: Applied Economics*, 12 (4): 164-95.

Modelos de elección discreta y conteo

Iyer, Rajkamal, and Manju Puri. 2012. "Understanding Bank Runs: The Importance of Depositor-Bank Relationships and Networks." *American Economic Review*, 102(4): 1414–45.

Dahl, G. and Card, D. "Family Violence and Football: The Effect of Unexpected Emotional Cues on Violent Behavior", *Quarterly Journal of Economics*, Vol. 126, No. 1, pp. 103-143, February 2011

Soluciones de Esquina: Tobit

*McDonald, J. and Moffitt, R., "The Uses of Tobit Analysis," *Review of Economics and Statistics*, vol. 62(2), May 1980, pp. 318-21.

Renáta Kosová, "Do Foreign Firms Crowd Out Domestic Firms? Evidence from the Czech Republic", *Review of Economics and Statistics*, 2010, 92:4, pp. 861-881

Auto-selección Muestral

*Heckman, J. "Sample Selection Bias as a Specification Error", *Econometrica*, vol. 47, no. 1 (1979), pp. 153-162

J. Glaser, D., & S. Rahman, A. (2011). Human Capital and Technological Transition: Insights from the U.S. Navy. *Journal of Economic History*, 71(3), 704-729. doi:10.1017/S0022050711001896

Control Sintético

*Abadie, Alberto. 2021. "Using Synthetic Controls: Feasibility, Data Requirements, and Methodological Aspects." *Journal of Economic Literature*, 59 (2): 391-425.

Abadie, Alberto, and Javier Gardeazabal. 2003. "The Economic Costs of Conflict: A Case Study of the Basque Country ." *American Economic Review*, 93 (1): 113-132. DOI: 10.1257/000282803321455188

Campos-Vazquez, R. y Esquivel, G. (2020). "The effect of doubling the minimum wage and decreasing taxes on inflation in Mexico", *Economics Letters*, Volume 189, <https://doi.org/10.1016/j.econlet.2020.109051>