

Programa en Teoría Econométrica

# Microeconometría

El objetivo general del curso es contribuir a la formación de investigadores en las universidades del país mediante el entrenamiento en el uso intensivo de métodos estadísticos y econométricos modernos. En ese sentido, este curso es esencialmente metodológico y pondrá especial énfasis en el diseño de investigación y el uso de la econometría como herramienta para testear hipótesis económicas de interés más que en la discusión de las propiedades teóricas de estimadores. En un sentido más general, el curso pretende contribuir a cerrar las brechas en términos de formación en métodos cuantitativos que todavía existe en el país. En esa dirección, los participantes del curso serán entrenados en el uso de métodos econométricos avanzados para la identificación de efectos causales, aprenderán como implementarlos mediante el uso de software especializado como STATA y aprenderán como relacionarlos con el diseño de una investigación específica. Dado el énfasis metodológico del curso, se pondrá especial atención al trabajo con los participantes en el diseño de propuestas de investigación (más detalles syllabus adjunto).

## TEMAS

### Sesión I

- Estimación por máxima verosimilitud
- Propiedades
- Modelos de respuesta binaria y bivalente
- Estimación, validación, predicción

### Sesión II

- Modelos de respuesta ordenada
- Modelos de respuesta nominal

### Sesión III

- Modelos de conteo
- Poisson, Binomial Negativa, Z-inflated, BiPoisson

### Sesión IV

- Modelos censurados y truncados
- Modelo de sesgo de selección. Heckman

### Sesión V

- Modelos de Duración: Análisis de Supervivencia
- Modelo de riesgos competitivos

### Sesión VI

- Panel estático: Modelos de efectos fijos y aleatorios
- Problemas de esfericidad y endogeneidad
- Modelos de Panel Dinámico (Anderson-Hsiao, Arellano-Bond, Arellano-Bover). Raíces unitarias en panel

### Sesión VII

- Modelos de Panel No Estacionarios. Cointegración
- Modelos de Panel con Variable Dependiente Binaria

### Sesión VIII

- Paneles Jerárquicos y Multinivel
- Fronteras estocásticas

### Sesión IX

- Evaluación de Impacto de Programas Sociales
- > Regresión No Paramétrica y Semi Paramétrica.
- > Evaluación de Impacto:
  - >> Efecto Tratamiento Promedio (ATE), Efecto Tratamiento sobre los Tratados (ATT)
  - >> Metodología de matching (vecino más cercano) y propensity score matching.
  - >> Regresión discontinua aguda y difusa.
  - >> Análisis Diff-Diff.

### Sesión X

- Análisis de Clasificación
- > Análisis de Cluster.
- > Análisis de Discriminante.
- > Análisis Factorial.
- Análisis Bayesiano y Redes Neuronales.

### Sesión XI

- Introducción al análisis espacial.
- Introducción a shp2dta y spmap.
- Estadísticos y Pesos.
- Modelos de Econometría Espacial.
- Estimación por máxima verosimilitud.
- Estimación por GMM.

## Módulo III

Virtual en Vivo



## INICIO

09 Sábado  
Mayo

11 sesiones - 33 hrs

Sab. y Dom.  
19:00 - 22:00  
(hora de Perú)

COSTO  
US\$ 330 + IGV

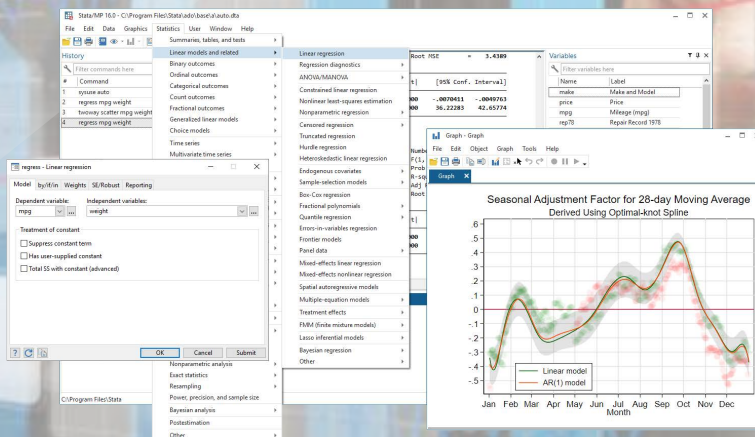
Curso 100% Práctico con STATA



Programa Modular en Econometría:

- **Módulo I: Econometría**
- **Módulo II: Series de Tiempo**
- **Módulo III: Microeconometría**

Evaluación supervisada en cada módulo



## Plana Docente

- MSc(c). Economics, BSc. Economic Engineering, de la Ponticia Universidad Católica del Perú Ing. Economista de la Universidad Nacional de Ingeniería. Con experiencia en docencia en cursos de capacitación de Análisis Estadístico, Cuantitativo y Econométrico Aplicado para prestigiosas entidades.



Mayor Información

✉ info@quants-group.com

☎ +51 938 117 737

www.quants-group.com