Curso Académico: (2020 / 2021)

Fecha de revisión: 07-07-2020

Departamento asignado a la asignatura:

Coordinador/a: LOPES MOREIRA DA VEIGA, MARIA HELENA

Tipo: Optativa Créditos ECTS : 6.0

Curso : 2 Cuatrimestre : 2

OBJETIVOS

Los modelos con variables dependientes discretas y aplicaciones de los métodos de datos de panel en todos los campos de la economía y de la economía de la empresa son cada cada vez más importantes. Este curso comienza con una breve revisión de los conceptos estudiados anteriormente en otros cursos del programa y se centra sobre todo en los problemas metodológicos y empíricos sobre el análisis de datos de panel y transversales en el contexto específico de los modelos económicos. Temas seleccionados en el análisis de series temporales, especialmente los temas de importancia para el análisis de datos de panel de modelos dinámicos, también serán discutidos. Una vez concluido satisfactoriamente este curso, los estudiantes tendrán una serie de herramientas econométricas sofisticadas que son de utilidad en la investigación empírica avanzada o trabajo profesional.

DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS: PROGRAMA

Tema 1. Regresores endógenos

1.1 Regresores estocásticos y las propiedades de los estimadores MCO

1.2 Errores de medida en las variables

1.3 Sesgo en modelos de ecuaciones simultáneas

1.4 Variables instrumentales

1.5 Contraste de endogeneidad

Tema 2. Modelos de variable dependiente discreta

2.1 Modelos de variable dependiente binaria

2.2 Estimación de modelos de variable dependiente binaria

2.3 Modelos Multinomiales

2.4 A Poisson model for count data

Tema 3. Modelos con variable dependiente acotadas

3.1 El modelo de regresión truncado

3.2 El modelo Topit

Tema 4. Datos de Panel

4.1 Modelos de panel básicos

4.2 Estimación de modelos de efectos fijos y aleatorios

4.3 Modelos de panel con variables binarias

4.4 Modelos dinámicos

SISTEMA DE EVALUACIÓN

It consists of a final exam (60%), four problem sets that will require theoretical and computational work (compulsory, 5%), and a project (35%). The project consists of reproducing some empirical results of a published paper or a student idea structured in a research paper.

Peso porcentual del Examen Final: 60

Peso porcentual del resto de la evaluación: 40

BIBLIOGRAFÍA BÁSICA

- Greene, W.H. Econometrics Analysis., Prentice-Hall. (Library code: D 330.43 GRE).
- Creel, M. Econometrics., Available at <http://pareto.uab.es/mcreel/Econometrics/econometrics.pdf>.
- Hayashi, F. Econometrics., Princeton University Press. (Library code: D 330.43 HAY)..