Econometría

Curso Académico: (2020 / 2021) **Fecha de revisión: 07/07/2020 12:14:42**

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 terán 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 estocasticos 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

Peso porcentual del Examen/Prueba Final:	60
Peso porcentual del resto de la evaluación:	40

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.

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)..

- Wooldridge, J.M. Introductory Econometrics: A Modern Approach., South Western College Publishing (Library code: D 330.43 WOO)..