

Curso Académico: (2021 / 2022)

Fecha de revisión: 11-05-2021

Departamento asignado a la asignatura: Departamento de Estadística

Coordinador/a: LOPES MOREIRA DA VEIGA, MARIA HELENA

Tipo: Obligatoria Créditos ECTS : 6.0

Curso : 1 Cuatrimestre : 2

OBJETIVOS

Los modelos con variables dependientes discretas y aplicaciones de los métodos de datos de panel en todos los campos de las ciencias sociales son de gran importancia. Este curso se centra principalmente en los aspectos metodológicos y empíricos sobre el análisis de datos transversales y de panel en el contexto específico de los modelos socioeconómicos. Temas seleccionados en el análisis de series temporales, especialmente los temas de importancia para el análisis de datos de panel dinámicos, también serán discutidos. Una vez concluida satisfactoriamente este curso, los estudiantes estarán provistos de una serie de herramientas econométricas sofisticados que son de utilidad en la investigación empírica avanzada o trabajo profesional.

DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS: PROGRAMA

1. Regresión múltiple con regresores estocásticos
 - 1.1 Revisión de conceptos básicos
 - 1.2 Distribuciones de los estimadores MCO
 - 1.3 Inferencia
 - 1.4 Intervalos de confianza
2. Modelos con variables dependientes categóricas.
 - 2.1 El modelo lineal de probabilidad.
 - 2.2 El modelo probit, logit y su interpretación.
 - 2.3 Estimación y inferencia en modelos con variables dependientes categóricas.
3. Otros modelos de variable dependiente cualitativa.
 - 3.1 Modelos multinomiales.
 - 3.2 Estimación y inferencia.
4. Modelos de conteo.
 - 4.1 Estimación y inferencia.
5. Modelos con datos de panel: modelos estáticos y control por heterogeneidad no observada.
 - 5.1 Modelos de efectos fijos.
 - 5.2 Modelos de efectos aleatorios.
 - 5.3 Tests de selección de modelo.

ACTIVIDADES FORMATIVAS, METODOLOGÍA A UTILIZAR Y RÉGIMEN DE TUTORÍAS

Actividades Formativas

Clase teóricas

Clases prácticas

Tutorías

Trabajo individual del estudiante

Metodologías docentes

Exposiciones en clase del profesor con soporte de medios informáticos y audiovisuales, en las que se desarrollan los conceptos principales de la materia y se proporciona la bibliografía para complementar el aprendizaje de los alumnos.

Lectura crítica de textos recomendados por el profesor de la asignatura.

Resolución de problemas planteados por el profesor de manera individual o en grupo.

Exposición y discusión en clase, bajo la moderación del profesor del proyecto realizado por el

estudiante.

SISTEMA DE EVALUACIÓN

Consiste en un examen final (60%) y un proyecto (40%). El proyecto consiste en reproducir algunos resultados empíricos de un artículo publicado o una idea propuesta por el estudiante estructurada en un artículo de investigación.

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).
- J. Scott Long Regression models for categorical and limited dependent variables, SAGE Publications.
- Jeffrey M. Wooldridge Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data,, MIT Press.

BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA

- Kosuke Imai Quantitative Social Science: An Introduction, Princeton University Press, 2018