

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 : 5.0

Curso : 1 Cuatrimestre : 2

REQUISITOS (ASIGNATURAS O MATERIAS CUYO CONOCIMIENTO SE PRESUPONE)

Estadística y métodos cuantitativos I

OBJETIVOS

Los modelos con variables dependientes discretas, y las aplicaciones de métodos de datos de panel en todos los campos de la economía se han vuelto cada vez más importantes. Este curso comienza con una breve revisión de los conceptos previamente realizados en otros cursos del programa, y se centra después, principalmente, en las cuestiones metodológicas y empíricas relativas al análisis de la sección transversal y los datos del panel en el contexto específico de los modelos económicos. También se discutirán temas seleccionados sobre el análisis de series temporales, especialmente temas de importancia para el análisis de datos de panel de modelos dinámicos. Al finalizar satisfactoriamente este curso, se proporcionará a los estudiantes una serie de sofisticadas herramientas econométricas que se utilizan en investigación empírica avanzada o en el desempeño profesional.

DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS: PROGRAMA

Capítulo 1. Endogeneidad de los regresores

1.1 Regresores estocásticos y las propiedades de los estimadores OLS

1.2 Errores de medición en las variables

1.3 Sesgo de ecuación simultáneas

1.4 Variables instrumentales

1.5 Contrastes de endogeneidad

Capítulo 2. Modelos con variables dependientes discretas

2.1 Modelos para la elección binaria

2.2 Estimación e inferencia en modelos de elección binaria

2.3 Modelos multinomiales

2.4 Un modelo de Poisson para datos de recuento

Capítulo 3. Modelos de variables dependientes limitadas

3.1 El modelo de regresión truncado

3.2 El modelo de regresión censurado

Capítulo 4. Datos de panel

4.1 Modelos básicos de datos de panel

4.2 Estimación y inferencia para modelos de efectos aleatorios y efectos fijos

4.3 Estimación de errores estándar en conjuntos de datos de panel en finanzas

ACTIVIDADES FORMATIVAS, METODOLOGÍA A UTILIZAR Y RÉGIMEN DE TUTORÍAS

La asignatura está organizada en clases de teoría cuyos materiales son transparencias y fichas de ejercicios para consolidación de los conceptos. Además hay varias sesiones en laboratorio donde los estudiantes utilizarán STATA.

SISTEMA DE EVALUACIÓN

Examen (60%), presentación de un artículo (10%) y un proyecto (30%). El proyecto consiste en reproducir algunos resultados empíricos de un artículo publicado o una idea de un 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).
- 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)..