

Curso Académico: ( 2021 / 2022 )

Fecha de revisión: 17-02-2022

Departamento asignado a la asignatura: Departamento de Economía

Coordinador/a: CACERES DELPIANO, JULIO

Tipo: Obligatoria Créditos ECTS : 6.0

Curso : 3 Cuatrimestre : 2

#### REQUISITOS (ASIGNATURAS O MATERIAS CUYO CONOCIMIENTO SE PRESUPONE)

Un curso introductorio a la Econometría.

#### OBJETIVOS

Este es un curso de introducción a la investigación empírica en economía. Se estudiarán tanto las técnicas econométricas en modelos lineales como los conocimientos de programación necesarios para la investigación aplicada en temas económicos. Se presentarán, y en algunos casos, replicarán estudios influyentes en la Economía.

#### DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS: PROGRAMA

Sección 1: Manejo de datos y regresión: Modelo de regresión lineal. Modelos de variable dependiente binaria. Utilización y organización de bases de datos en gretl. Regresión en gretl.

Sección 2: Variables instrumentales: Variables explicativas endógenas. Consecuencias sobre la estimación y la inferencia. Instrumentos válidos. Contrastes de endogeneidad y de restricciones de sobreidentificación.

Sección 3: Datos Agregados de Secciones Cruzadas. Estimador de diferencias en diferencias. Paneles de datos. Estimador de primeras diferencias. Estimador de efectos fijos. Estimador de efectos aleatorios.

#### ACTIVIDADES FORMATIVAS, METODOLOGÍA A UTILIZAR Y RÉGIMEN DE TUTORÍAS

El curso se dividirá en tres partes:

- Lecciones teóricas centradas en la presentación de un conjunto de estudios empíricos clásicos. Para facilitar su desarrollo los alumnos tendrán textos básicos de referencia que les permita completar y profundizar en aquellos temas en los cuales estén más interesados.
- Lecciones teóricas encaminadas al desarrollo de conocimientos intermedios en el uso de paquetes econométricos. Para facilitar su desarrollo los alumnos recibirán las notas de clase.
- Clases prácticas en salas de ordenador encaminadas a que el alumno replique algunos trabajos empíricos analizados en clase.

Las lecciones teóricas tendrán como objetivo facilitar la lectura de artículos especializados en economía aplicada. Las clases de ordenador buscarán la formación de los alumnos en paquetes econométricos para poder realizar trabajo empírico. La puesta en común de las respuestas a los ejercicios de las clases prácticas y la corrección conjunta debe servir para afianzar conocimientos y desarrollar la capacidad para analizar y comunicar la información relevante para la resolución de problemas. Además la puesta en común favorecerá el intercambio de opiniones críticas tanto entre profesor y alumnos como entre alumnos.

#### SISTEMA DE EVALUACIÓN

La evaluación continua se articula en tres pruebas programadas a lo largo del curso, cuyas fechas son inamovibles, no siendo posible realizar ninguna prueba en fechas u horas distintas a las establecidas al comienzo del cuatrimestre para cada grupo. La no asistencia a una prueba supondrá una calificación cero en dicha evaluación, y la no asistencia a dos pruebas supondrá un cero en la calificación final. Aquellos estudiantes que no hayan realizado una prueba pero sí las dos restantes podrán realizar, en la última semana del curso, una prueba recuperativa para sustituir la calificación de cero en la prueba no realizada.

La prueba recuperativa será en la última semana del curso y en ella se evaluará el material no evaluado

Nota en Convocatoria Ordinaria = Evaluación Continua

Nota en Convocatoria Extraordinaria=  $\max\{\text{Evaluación Continua ; Final}\}$

<b>Peso porcentual del Examen Final:</b>	0
<b>Peso porcentual del resto de la evaluación:</b>	100

#### BIBLIOGRAFÍA BÁSICA

- James H. Stock y Mark M. Watson Introducción a la Econometría, Pearson, 2012
- Joshua Angrist y Jörn-Steffen Pischke Dominar la econometría. El camino entre el efecto y la causa, Antoni Bosch, 2016