Microeconometría

Curso Académico: (2021 / 2022) **Fecha de revisión: 24-05-2021**

Departamento asignado a la asignatura: Departamento de Economía

Coordinador/a: CARRASCO PEREA, RAQUEL

Tipo: Obligatoria Créditos ECTS : 6.0

Curso : 1 Cuatrimestre : 2

REQUISITOS (ASIGNATURAS O MATERIAS CUYO CONOCIMIENTO SE PRESUPONE)

Estadística, Econometría

OBJETIVOS

El objetivo de este curso es proporcionar al estudiante las herramientas econométricas avanzadas generalmente usadas en el análisis empírico de micro-datos. El estudiante adquirirá un conocimiento profundo de técnicas de estimación de modelos de datos de panel y de modelos no lineales. Estos objetivos se logran a través de clases teóricas, clases prácticas, y manejo de datos reales.

DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS: PROGRAMA

1. Método Genralizado de Momentos. Estimación y propiedades asintóticas de los estimadores. Tests de especificación y de validez de los instrumentos.
2. Modelos lineales para datos de panel. Modelos estáticos y control de la heterogeneidad inobservable. Estimación intra-grupos, entre grupos y GLS. Tests de especificación. Modelos dinámicos. Estimación GMM de modelos de datos de panel dinámicos.
3. Modelos de elección discreta: modelos de probabilidad lineal, probits, logits. Interpretación. Estimación por Máxima Verosimilitud. Modelos de elección múltiple. Supuesto de IIA. Modelos ordenados.
4. Modelos de selección muestral. Modelos tobit y modelos truncados. Modelos generalizados de selección. Modelos de regresiones alternantes.

ACTIVIDADES FORMATIVAS, METODOLOGÍA A UTILIZAR Y RÉGIMEN DE TUTORÍAS

En este curso las sesiones prácticas son esenciales para el aprendizaje. Por tanto, se harán ejercicios en las salas de ordeandores utilizando bases de datos reales y replicando resultados de artículos publicados. Se dará especial importancia a la interpretación de los resultados con el objetivo de ofrecer recomendaciones de política económica. El curso consiste en 15 horas de sesiones teóricas y 15 horas de sesiones prácticas.

Para el análisis empírico de los datos se utilizará el programa STATA. También los alumnos pueden atender a las horas de tutorias, donde se les ofrece un trato personalizado para resolver sus dudas específicas.

SISTEMA DE EVALUACIÓN

La nota final se basa en:

Pruebas de evaluación continua realizadas en clase (50%)
Examen Final (50%)

Peso porcentual del Examen Final:	50
Peso porcentual del resto de la evaluación:	50

BIBLIOGRAFÍA BÁSICA

- Amemiya, T. Advanced Econometrics, Blackwell, 1985
- Arellano, M. Panel Data Econometrics, Oxford University Press, 2003
- Cameron, A.C. y P.K. Trivedi Microeconometrics, Cambridge University Press, 2005
- Deaton, A. The analysis of household surveys, John Hopkins University Press, Baltimore, 1997

- Goldberger, A.S. A course in econometrics, Harvard University Press, 1991

- Gourieroux, C. Econometrics of qualitative dependent variables, Cambridge University Press, 2000

BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA

- Angrist, J.D. and J.-S. Pischke. Mostly Harmless Econometrics: An Empiricists¿s Companion, Princeton University Press, 2009