

Curso Académico: ( 2022 / 2023 )

Fecha de revisión: 13-06-2022

Departamento asignado a la asignatura: Departamento de Economía

Coordinador/a: CARRASCO PEREA, RAQUEL

Tipo: Obligatoria Créditos ECTS : 9.0

Curso : 2 Cuatrimestre : 1

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

Cursos de posgrado en Econometría I y Econometría II (Máster en Análisis Económico)

**OBJETIVOS**

El objetivo de este curso es vincular los métodos econométricos para la estimación de los efectos causales a los datos. Cubriremos una serie de temas teóricos que son importantes en la investigación aplicada en economía laboral, economía de la salud, organización industrial y campos relacionados.

El curso se organizará en conferencias para proporcionar el marco económico y los problemas econométricos de cada tema. Las conferencias se complementarán con conjuntos de problemas, que incluyen ejercicios teóricos y empíricos. Los estudiantes deben manejar el programa Stata por su cuenta y leer los documentos relacionados.

**DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS: PROGRAMA**

1. Estrategias empíricas para la identificación de efectos causales.
  - 1.1. Objetivos y métodos de investigación empírica.
  - 1.2. Estructuras de datos microeconómicos
  - 1.3. Relaciones causales de interés.
  - 1.4. El problema de identificación: resultados potenciales y causalidad
2. Experimentos sociales
  - 2.1. Ventajas de los experimentos aleatorios: la condición de independencia.
  - 2.2. Validez interna y externa
  - 2.3. Ejemplos
3. Selección en observables
  - 3.1. Identificación con datos de observación.
  - 3.2. Independencia condicional
  - 3.3. Independencia media condicional
  - 3.4. Regresión y causalidad
4. Matching
  - 4.1. Introducción
  - 4.2. Métodos y supuestos coincidentes
  - 4.3. Puntaje de propensión
  - 4.4. Relación con regresión
5. Identificación utilizando información externa.
  - 5.1. Experimentos naturales y variables instrumentales (IV)
  - 5.2. Identificación mediante IV. El estimador de Wald
  - 5.3. Efectos del tratamiento promedio local (TARDE)
  - 5.4. Enfoque de la función de control
6. Diseños de regresión discontinua (RD)
  - 6.1. Discontinuidades en las reglas de asignación
  - 6.2. Diseños RD agudos y difusos
7. Diferencias en las diferencias (DD)
  - 7.1. Experimentos naturales y DD
  - 7.2. El supuesto de identificación fundamental

7.3. Diferencias en diferencias en diferencias (DDD)

7.4. Métodos de control sintéticos

7.5. DD con datos del panel

8. Métodos cuantiles

8.1. Cuantiles incondicionales y condicionales

8.2. Regresión cuantil (QR). Interpretación

8.3. Extensiones

9. Estimación estructural

9.1. Parámetros de la política

9.2. Problemas computacionales

9.3. Métodos de estimación.

9.4. Aplicaciones

## SISTEMA DE EVALUACIÓN

La calificación se basará en un examen a mitad del cuatrimestre (40%), una presentación al final del cuatrimestre (20%) y un examen final (40%)

Peso porcentual del Examen Final 40

Peso porcentual del resto de la evaluación 60

Tanto en convocatoria ordinaria como extraordinaria será requisito para aprobar la asignatura el obtener al menos un 4 sobre 10 en el examen final. En aquellos casos en los que, tras la ponderación de las calificaciones obtenidas en las actividades de evaluación continua y la del examen final, la calificación final de un estudiante sea mayor o igual a 5 pero no haya alcanzado la nota mínima exigida en el examen final, la calificación final a reflejar en su expediente académico será 4 (Suspendo), a no ser que la calificación obtenida en el examen final sea inferior a 3, en cuyo caso la calificación final de la asignatura será 3 (Suspendo).

**Peso porcentual del Examen Final:** 40

**Peso porcentual del resto de la evaluación:** 60

## BIBLIOGRAFÍA BÁSICA

- A. Colin Cameron & Pravin K. Trivedi Microeconometrics: Methods and Applications, Cambridge University Press, 2005

- Jeffrey M. Wooldridge Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data, MIT Press, 2010

- Joshua D. Angrist & Jörn-Steffen Pischke Mostly Harmless Econometrics. An Empiricist's Companion, Princeton University Press, 2009

- Pravin K. Trivedi & A. Colin Cameron Microeconometrics Using Stata, Revised Edition, Stata Press, 2010