

Titulación: ECONOMIA			
Departamento: FUNDAMENTOS ANALISIS ECONOMICO II			
Curso académico: 2006-07		Plan: 2000	
Nombre de asignatura: MICROECONOMETRIA			Código: 765
Curso: QUINTO	Periodo de impartición: SEGUNDO SEMESTRE	Carácter: OPTATIVA	Créditos: 6
Horas semanales: 4		Teoría: 3	Prácticas: 1
Nombre del profesor/es que imparte/n la asignatura:			
MERCEDES GRACIA DIEZ Y TEODOSIO PEREZ AMARAL			
Objetivos:			
ENSEÑAR EL USO DE LAS TECNICAS ECONOMETRICAS APLICADAS A DOS TIPOS DE DATOS CADA VEZ MAS FRECUENTES, Y CUYO CONOCIMIENTO ES YA IMPRESCINDIBLE PARA EL TRABAJO APLICADO.			
Competencias o destrezas que se van a adquirir:			
PLANTEAR LA MODELIZACION CON ESTOS TIPOS DE DATOS, CONOCER SUS VENTAJAS E INCONVENIENTES Y APRENDER LAS TECNICAS Y LOS PROGRAMAS DE SOFTWARE ADECUADOS PARA LOS MISMOS.			
Prerrequisitos para cursar la asignatura:			
LOS QUE SEÑALE EL PLAN DE ESTUDIOS VIGENTE			
Contenido:			
DOS PARTES TEORICAS DE DATOS DE CORTE TRANSVERSAL Y PANEL ASI COMO PRACTICAS CON EVIEWS Y STATA. SE HARAN Y EXPONDRAN VARIOS TRABAJOS APLICADOS			
Bibliografía básica recomendada:			
Wooldridge, Analysis of Cross Section and Panel Data y Hsiao, Analysis of panel data.			
Método docente:			
Clases teóricas, clases prácticas con ordenador, estudio personal del material docente y realización de trabajos aplicados con datos reales.			
Tipo de evaluación:			
Exámenes escritos, trabajos escritos y exposición oral de los trabajos.			
Idioma en que se imparte: Español			
Observaciones: Este curso es muy útil y asequible para las personas que van a hacer trabajo aplicado, sean de LADE, de LECO o de otras titulaciones. También es útil para las personas de la especialidad de Análisis Económico que vayan a hacer trabajo aplicado.			

MODELOS DE ELECCIÓN BINARIA, Mercedes Gracia

Tema 1. Modelos de elección discreta. Introducción.

- 1.1 Justificación de los modelos de elección discreta. Decisiones de los individuos y Teoría Microeconómica.
- 1.2 Objetivos de estos modelos. Interpretación en términos de probabilidad.
- 1.3 Modelos de elección binaria y modelos de elección múltiple

Tema 2. Modelos de elección binaria: especificación

- 2.1 Formas funcionales: modelos probit y logit.
- 2.2 Derivación a partir de un modelo econométrico lineal con variable dependiente latente
- 2.3 Interpretación de los coeficientes. Casos prácticos
- 2.4 El modelo lineal de probabilidad. Limitaciones.

Tema 3. Modelos de elección binaria: estimación e inferencia

- 3.1 Estimación por MV con datos individuales
- 3.2 Estimación por MCG con datos agrupados
- 3.3 Inferencia

REFERENCIAS

- Amemiya, T (1981) "Qualitative Response Models: a Survey", *Journal of Economics Literature*, XIX, 1483-1536
- Gracia-Díez, M. (1991) "A Qualitative Analysis of Unemployment in Spain", *Review of Labor Economics and Industrial Relations*, 5, 2, 159-173
- Judge, G.G., R.C. Hill, W.E. Griffiths, H. Lutkepohle y T.C. Lee (1982), *Introduction to the Theory and Practice of Econometrics*, John Wiley, New York
- Maddala, G.S. (1983) *Limited Dependent and Qualitative Variables in Econometrics*, Cambridge University Press, Cambridge
- Wooldridge, J. (2002) *Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data*, The MIT Press Cambridge, Massachusetts

PANEL, Teodosio Pérez Amaral,

Objetivos: en esta parte del curso se pretende explicar las principales ventajas e inconvenientes de los datos de panel y dar a conocer las técnicas econométricas más habituales para su tratamiento. Asimismo, se pretende familiarizar al alumno con el análisis aplicado de datos de panel y con el manejo de algunos paquetes econométricos, usando datos reales.

Evaluación: se utilizará un sistema de evaluación continua que supone la calificación de un trabajo de curso individual, su exposición en clase y uno o dos exámenes. El aprobado por curso exime de la realización del examen final.

Tema 1. Introducción.

- 1.1 Los datos de panel, ventajas e inconvenientes
- 1.2 Algunas cuestiones habituales: sesgo de heterogeneidad y sesgo de selección
- 1.3 Paquete estadístico: STATA8.

Hsiao (2003).

Tema 2. Análisis de covarianza.

- 2.1 Contrastes F
- 2.2 Análisis de covarianza

Hsiao (2003),

Tema 3. Modelo de regresión con efectos individuales.

- 3.1 Introducción
- 3.2 Modelo de efectos fijos. Estimador intra-grupos
- 3.3 Modelo de efectos variables. Estimador de Mínimos Cuadrados Generalizados
- 3.4 Estimación por máxima verosimilitud
- 3.5 La elección entre efectos fijos y efectos variables
- 3.6 Contrastes de especificación
- 3.7 Modelos con efectos individuales y temporales específicos
- 3.8 Modelos con errores correlacionados
- 3.9 Errores de medida

Hsiao (2003)

Tema 4. **Modelos dinámicos.**

- 4.1 Introducción
- 4.2 Modelo de efectos fijos
- 4.3 Modelo de efectos aleatorios
- 4.4 Sesgo del estimador MCO
- 4.5 Estimación por variables instrumentales

Hsiao (2003), Arellano y Bover (1995)

Tema 5. **Modelos de Ecuaciones simultáneas.**

- 5.1 Introducción.
- 5.2 Estimación de una sola ecuación.
- 5.3 Variables instrumentales.

Hsiao (2003)

Tema 6. **Paneles incompletos.**

- 6.1 Retardos distribuidos.
- 6.2 Datos ausentes de forma aleatoria.
- 6.3 Datos ausentes de forma no aleatoria.
- 6.4 Una sola serie temporal y un solo corte transversal.

Hsiao (2003)

Tema 7. **Datos truncados y censurados**

- 7.1 Introducción.
- 7.2 Modelo Tobit con efectos aleatorios.
- 7.3 Modelo Tobit con efectos fijos.
- 7.4 Modelo de Heckman.
- 7.5 Modelos Tobit dinámicos.

Hsiao (2003)

REFERENCIAS

Arellano, M. (2003) "Panel data Econometrics" Oxford University Press.

Arellano, M. y S. Bond (1991) "Some Tests of Specification for Panel Data: Monte Carlo evidence and an application to employment equations", *Review of Economic Studies*, 58, 277-297.

- Arellano, M. y O. Bover (1995) "Another Look at the Instrumental Variable Estimation of Error Components Models", *Journal of Econometrics*, 68, 1, 29-51.
- Engle, R. F. (1984) "Wald, likelihood ratio and lagrange multipliers tests in Econometrics", *Handbook of Econometrics*, Cap. 13, M. Intriligator y Z. Griliches, eds., North Holland, Amsterdam.
- EViews, 4 (1998) *User's guide, Reference Manual*, Quantitative Micro Software, Irvine, California.
- Garín, T y Teodosio Pérez Amaral (1998) "Econometric Modelling of Spanish Very Long Distance International Telephone traffic", *Information Economics and Policy*, 10, 2, 237-252.
- Garín, T. y Teodosio Pérez Amaral (1999) "A Model of Spain-Europe Telecommunications", *Applied Economics*, 31, 989-997.
- Garin Muñoz, T. y Teodosio Pérez Amaral (2001) "An Econometric Model for International Tourism Flows to Spain", *Applied Economics Letters*, 7, 525-529.
- Godfrey, L. G. (1988) Misspecification Tests in Econometrics: the Lagrange Multiplier Principle and Other Approaches, *Econometric Society Monographs*, 16, Cambridge University Press.
- Hausman, J. (1978) "Specification Tests in Econometrics", *Econometrica* 46:1251-71.
- Hausman, J. A., y W. E. Taylor (1981) "Panel data and Unobservable Individual Effects", *Econometrica* 49:1377-9.
- Hsiao, C. (2003) Analysis of Panel Data, second edition, *Econometric Society Monographs*, Cambridge University Press.
- Marín, E., Teodosio Pérez Amaral, Antonio Rua y E. Hernández (2001) "The evolution of the Ph in Europe 1986-1997 with panel data", *Chemosphere*, 45, 329-337.
- Mundlak, Y. (1978) "On the Pooling of Time Series and Cross Section Data" *Econometrica* 46, 69-85.
- Stata (2002) Stata8 User's Guide, Stata Press, College Station, Texas.
- White, H. (1984) Asymptotic Theory for Econometricians, Academic Press.
- White, H. (1996) Estimation, Inference and Specification Analysis, *Econometric Society Monographs*, 22, Cambridge University Press.
- Wooldridge, J. (2002) Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data. The MIT Press Cambridge, Massachusetts