VNIVERSITAT DE VALÈNCIA

Guía Docente
44953 Microeconometría

FICHA IDENTIFICATIVA

Datos de la Asignatura

Código	44953
Nombre	Microeconometría
Ciclo	Máster
Créditos ECTS	5.0
Curso académico	2023 - 2024

Titulación(es)

Titulación	Centro	Curso	Periodo
2242 - Máster Universitario en Economía	Facultad de Economía	1	Primer cuatrimestre

Materias

Titulación	Materia	Carácter
2242 - Máster Universitario en Economía	10 - Materia instrumental	Optativa

Coordinación

Nombre	Departamento
ROCHINA BARRACHINA, MARIA ENGRACIA	132 - Estructura Económica
SANCHIS LLOPIS, JUAN ALBERTO	132 - Estructura Económica

RESUMEN

La Microeconometría es una asignatura del segundo semestre del Máster en Economía. El objetivo de esta asignatura es proporcionar a los economistas conocimientos suficientes sobre los temas más actualizados en microeconometría, para que puedan elegir los estimadores más apropiados y aprovechar tanto las bases de datos como los modelos económicos.

El programa está diseñado para satisfacer las necesidades de investigadores y profesionales al trabajar con datos reales, donde una dimensión importante en la unidad de análisis es el individuo. Esto requiere el uso de microdatos y el empleo de técnicas avanzadas en (micro)econometría.

El contenido práctico de este curso tiene dos objetivos: por un lado, el conocimiento y manejo del paquete estadístico-econométrico STATA; por otro lado, y en cada uno de los temas, ser capaz de resolver casos prácticos que requieran el uso de los diversos estimadores explicados en la parte teórica del programa.

CONOCIMIENTOS PREVIOS

Relación con otras asignaturas de la misma titulación

No se han especificado restricciones de matrícula con otras asignaturas del plan de estudios.

Otros tipos de requisitos

No hay restricciones de matriculación especificadas con otras asignaturas del currículum.

Econometría en el primer semestre del Máster en Economía.

COMPETENCIAS (RD 1393/2007) // RESULTADOS DEL APRENDIZAJE (RD 822/2021)

2242 - Máster Universitario en Economía

- Que los/las estudiantes sepan aplicar los conocimientos adquiridos y su capacidad de resolución de problemas en entornos nuevos o poco conocidos dentro de contextos más amplios (o multidisciplinares) relacionados con su área de estudio.
- Que los/las estudiantes sean capaces de integrar conocimientos y enfrentarse a la complejidad de formular juicios a partir de una información que, siendo incompleta o limitada, incluya reflexiones sobre las responsabilidades sociales y éticas vinculadas a la aplicación de sus conocimientos y juicios.
- Que los/las estudiantes sepan comunicar sus conclusiones y los conocimientos y razones últimas que las sustentan a públicos especializados y no especializados de un modo claro y sin ambigüedades.
- Que los/las estudiantes posean las habilidades de aprendizaje que les permitan continuar estudiando de un modo que habrá de ser en gran medida autodirigido o autónomo
- Poseer y comprender conocimientos que aporten una base u oportunidad de ser originales en el desarrollo y/o aplicación de ideas, a menudo en un contexto de investigación.

RESULTADOS DE APRENDIZAJE (RD 1393/2007) // SIN CONTENIDO (RD 822/2021)

Al finalizar el curso con éxito, el estudiante debería ser capaz de:

- Conocer y comprender métodos microeconométricos avanzados.
- Elegir entre ellos en función del problema económico en cuestión.
- Saber cómo estimar un modelo económico específico utilizando datos reales, técnicas adecuadas y manejando el paquete estadístico-econométrico STATA.
- Familiarizarse con el uso de bases de datos españolas e internacionales.
- Ser capaz de interpretar los resultados de las estimaciones desde una perspectiva económica.

DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS

1. Modelos de datos de panel.

1.1. Efectos fijos y efectos aleatorios.
1.2. Modelos estáticos.
1.2.1. El estimador de efectos aleatorios: Mínimos cuadrados generalizados (GLS).
1.2.2. El estimador de efectos fijos: Intragrupos (WG) y regresión de dummies individuales.
1.2.3. Efectos aleatorios versus efectos fijos: prueba de Hausman.
1.2.4. Algunas extensiones de variables instrumentales (IV) para los estimadores aleatorios y de efectos fijos.
1.3. Modelos dinámicos.
1.3.1. Problemas en la estimación de modelos dinámicos con datos de panel.
1.3.2. El estimador de Arellano y Bond: Una aplicación del estimador del Método Generalizado de Momentos (GMM).
1.3.3. La prueba de Sargan de sobreidentificación de restricciones.
1.3.4. La prueba de correlación de errores idiosincrásicos.
1.3.5. El estimador de Arellano y Bover, y el de Blundell y Bond: el estimador del Método Generalizado de Momentos del Sistema (Sistem-GMM).

2. Modelos de elección discreta.

2.1. Introducción.
2.2. Modelos de respuesta binomial: el modelo de probabilidad lineal para respuesta binaria; y, los modelos Probit y Logit. Estimación por máxima verosimilitud.
2.3. Reportando los resultados para Probit y Logit.
2.4. Modelos de elección discreta multinomial: modelos no ordenados (logit multinomial), modelos de elección probabilística (logit multinomial condicional) y modelos no ordenados.

3. Modelos de variable dependiente censurada.

3.1. Introducción.
3.2. El modelo Tobit.
3.3. Estimación e inferencia del modelo Tobit.
3.4. Reportando los resultados.
3.5. Método de Heckman (modelo de selección de muestra).

4. Modelos de datos COUNT.

4.1. Definición, ejemplos y funciones de distribución.
4.2. modelo de veneno.
4.2.1. Función de distribución, propiedades y supuestos.
4.2.2. Estimador de máxima verosimilitud y consistencia.
4.2.3. Interpretación de coeficientes: Efectos marginales.
4.2.4. Principal limitación del modelo de Poisson, consecuencias y soluciones.

4.3. Modelo binomial negativo.
4.4. Modelos COUNT de datos ZERO INFLATED . (Zero inflated count data models.)

5. Algunos temas avanzados en inferencia causal.

VOLUMEN DE TRABAJO

ACTIVIDAD	Horas	% Presencial
Clases de teoría	40,00	100
Prácticas en aula	10,00	100
Asistencia a eventos y actividades externas	5,00	0
Elaboración de trabajos individuales	10,00	0
Estudio y trabajo autónomo	35,00	0
Preparación de clases prácticas y de problemas	25,00	0
TOTAL	**125,00**	

METODOLOGÍA DOCENTE

El desarrollo del curso se estructura en torno a tres elementos.

En primer lugar, las clases teóricas, donde se explican los conceptos más importantes y se ilustra el uso de técnicas de análisis esenciales. Se hará referencia a la literatura más relevante. La asistencia a estas clases se considera crucial, ya que garantiza una adecuada transmisión de conocimientos y, al mismo tiempo, sirve como orientación personal para los estudiantes.

En segundo lugar, las clases prácticas donde se resuelven ejercicios con bases de datos reales y se utiliza el paquete estadístico-econométrico STATA. De esta manera, los estudiantes adquirirán los conocimientos suficientes para resolver ejercicios personales que se entregarán durante el desarrollo de la asignatura.

En tercer lugar, el estudio y la preparación de materiales por parte del estudiante, así como la asistencia a seminarios académicos.

EVALUACIÓN

La composición de la nota final para este tema será del 80% de la puntuación del examen y del 20% del trabajo desarrollado por el estudiante a lo largo del curso.

REFERENCIAS

Básicas

- Cameron, A. C., and Trivedi, P. K. (2005): Microeconometrics: Methods and applications. Cambridge University Press.
  Greene, W. H. (2003): Econometric analysis. 7th edition. Prentice-Hall.
  Wooldridge, J. M. (2006): Introductory econometrics: a modern approach. South-Western.
  Wooldridge, J. M. (2008): Econometric analysis of cross section and panel data, 2nd edition. The MIT press.

Complementarias

- Topic 1
  Arellano, M. (2003): Panel data econometrics. Oxford University Press.
  Hsiao, C. (1986): Analysis of Panel Data. Econometric Society Monographs, Cambridge.
  Lee, M. J. (2002): Panel data econometrics: Methods of moments and limited dependent variables. Elsevier Science.
  Topics 2 & 3
  Lee, M. J. (2002): Panel data econometrics: Methods of moments and limited dependent variables. Elsevier Science.
  Maddala, G.S. (1983): Limited Dependent and Qualitative Variables in Econometrics, Cambridge.
  Topic 4
  Winkelmann, R. (1997): Econometric analysis of count data. Springer.
  Topic 5
  Angrist; J. D. and J.S. Pischke (2008) , Mostly Harmless Econometrics: An Empiricists Companion, Princeton University Press.
  Cunningham, S. (2021). Causal inference: The mixtape. Yale university press.