

Pla Docent

Econometria III (20853), curs 2014-15

Professors

Grup 1 & 2: Classes magistrals: Sergi Jiménez (Dx 20.280)
Dilluns i Dimarts de 11 a 12:30 (grup 1) i de 13:00 a 14:30 (grup 2)

Seminaris: Jaume Garcia (104,105,106,204,205,206)
Sergi Jiménez (101,102,103,201,202,203)

Presentació

El curs d'Econometria III tanca la seqüència de cursos d'Econometria. És un curs dedicat a l'estudi de les eines econòmiques adequades per al tractament de dades individuals (Microeconometria). És a dir, dades que provenen d'enquestes i, per tant, les observacions fan referència a persones físiques, unitats familiars o empreses. Aquest és un tipus d'informació cada cop més habitual en l'anàlisi empírica, tant per la creixent accessibilitat a les microdades de les estadístiques oficials, com pel creixent nombre d'enquestes que empreses i institucions realitzen per a recollir informació.

Els temes analitzats fan referència, sobretot, a dades en un moment en el temps (secció creuada o *cross-section*), encara que es dediquen dos temes a dades longitudinals i a dades de panell (mostres d'individus per als que es disposa d'informació en diferents períodes).

Des del punt de vista economètric els elements que caracteritzen els continguts del curs són:

- El tractament de la informació qualitativa, tant com a factor explicatiu (regressor) com a factor a explicar (variable depenent). Serveixin d'exemples el sector d'activitat econòmica i l'elecció del tipus de transport, respectivament.
- Les implicacions en termes d'estimació de variables dependents que són el resultat d'una decisió i d'una variable quantitativa. Per exemple, la despesa en tabac és el resultat d'una decisió (consumir tabac que comporta despesa zero) i una variable quantitativa (la quantia de la despesa per a aquells que consumeixen).
- La rellevància de la representativitat de la mostra a l'hora de decidir les tècniques a utilitzar. Per exemple, en el cas de la despesa en tabac disposar únicament informació d'aquells que realitzen una despesa positiva.

- L'interès en modelitzar com afecta el temps que un individu porta en un estat (per exemple, l'atur) sobre la probabilitat d'abandonar-lo.
- Els avantatges de les dades de panell a l'hora de poder controlar factors inobservables que amb dades relatives a un únic període podrien generar la inconsistència dels mètodes d'estimació habituals.

Tot i ser un curs de caràcter instrumental, la part aplicada del mateix té un pes important dintre de l'assignatura.

Competències

Competències prèvies

- Coneixements fonamentals del model de regressió, de la contrastació d'hipòtesis i del mètode de la màxima versemblança (a nivell introductori).
- Coneixement bàsic del paquet economètric *STATA*.
- Coneixements fonamentals d'economia que permetin a l'alumne llegir treballs empírics on s'utilitzin les tècniques econòmriques del curs.

Competències específiques

- Capacitat per modelitzar factors qualitatius en el marc d'un model economètric
- Capacitat per especificar el model economètric adequat per al tipus de qüestió objecte d'estudi
- Capacitat per traduir les característiques de la mostra utilitzada en termes de les eines econòmriques a utilitzar
- Capacitat per fer una interpretació adequada (qualitativa i quantitativa) dels resultats de l'estimació dels diferents models microeconòmrics

Competències transversals

- Capacitat per treballar amb dades
- Capacitat d'anàlisi i de síntesi dels resultats obtinguts a l'anàlisi empíric
- Treball en equip
- Capacitat de comunicació dels resultats d'anàlisis quantitatives

Activitats d'ensenyament i aprenentatge

Les activitats d'ensenyament de l'assignatura s'organitzen en 20 classes magistrals i 6 seminaris d'hora i mitja de durada. Apart, la preparació de les classes i els seminaris comporta una activitat d'aprenentatge a desenvolupar individualment i en equip.

Les classes magistrals es dedicaran fonamentalment a desenvolupar els 9 temes que componen el programa de l'assignatura. Aquestes exposicions s'hauran de completar amb la lectura dels apartats o seccions corresponents d'algun dels llibres que apareixen a la bibliografia. En cada tema es completarà amb una exemple amb STATA i la discussió d'un treball d'investigació il·lustratiu.

Els seminaris es dedicaran a la discussió de les lectures i dels exercicis empírics que s'hagin proposat en relació als temes tractats a les classes magistrals. Aquests exercicis es podran realitzar en petits grups de treball per tal de potenciar el treball en equip i la confrontació d'idees i plantejaments fora de l'aula. Malgrat això, l'entrega i l'avaluació (mitjançant la participació activa) serà individual. Finalment, es comentarà i discutirà en cada seminari un article empíric relacionat amb els temes de les classes magistrals.

Els exercicis s'hauran de lliurar cada setmana, així com un resum de no més de 2000 caràcters (espais inclosos) de la lectura de cada seminari. El resum haurà de fer referència a l'objectiu de l'estudi, les peculiaritats econòmiques del mateix i els resultats més rellevants. Les llistes d'exercicis i les lectures estaran accessibles al Campus Global.

Avaluació

Per tal de superar l'assignatura sobre un total de 100 punts s'han d'obtenir 50, d'acord amb la següent distribució:

Examen final: 60 punts (mínim estricte de 21 per poder superar l'assignatura)

Presentació de les llistes d'exercicis i els resums (condicional a la participació activa en el seminaris), participació (activa, NO BASTA AMB ASSISTIR) en els seminaris: 40 punts

Recuperació

Es pot recuperar l'examen final a les dates assignades al mes de maig (data exacta per determinar). **Només** podran recuperar l'examen final aquells que hagin assistit i participat als seminaris i que tinguin una nota mínima de 12/60 a l'examen final.

Referències bibliogràfiques

Bàsiques

GUJARATI, Damodar N. y Porter *Econometría*. (4a edición) McGraw Hill, 2004.

JONES, Andrew. *Applied Econometrics for Health Economists*. 2a. ed. Radcliffe Publishing, 2007.

STOCK, J. H.; WATSON, M. W. *Introducción a la Econometría*, 3a edición, Pearson. 2012.

WOOLDRIDGE, Jeffrey M. *Introducción a la Econometría, un enfoque moderno*. 4ª edició. Gengage, 2010a. (també son valides les edicions anteriors).

Intermedies

GREENE, William H. *Análisis econométrico*. 3a. ed. Madrid: Prentice Hall, 1999.

Avançades

CAMERON, A. Colin; TRIVEDI, Pravin K. *Microeconometrics. Methods and applications*. Cambridge: Cambridge University Press, 2005.

CAMERON, A. Colin; TRIVEDI, Pravin K. *Microeconometrics using STATA*, STATA press, 2009.

GARCIA-PEREZ, JI (ed), Metodología y diseño de estudios para la evaluación de políticas públicas, UPO, 2009

WOOLDRIDGE, Jeffrey M. *Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data*. Cambridge: MIT Press, 2010b.

Programa de l'assignatura

Tema 1: Variables explicatives qualitatives

Greene, 8.2
Gujarati, Cap. 9
Wooldridge (2010a), 7.1 a 7.4
+ notes de classe

Tema 2: Models d'elecció discreta amb dues alternatives

Cameron i Trivedi, 14.1 a 14.3
Greene, 19.2, 19.3, 19.4.3
Gujarati, Cap. 15
Jones, Cap. 3
Stock i Watson, 11
Wooldridge (2010a), 7.5 i 17.1
Wooldridge (2002), 15.1 a 15.6
+notes de classe

Tema 3: Models d'elecció discreta amb tres o més alternatives

Cameron i Trivedi, 15.1 a 15.4
Greene, 19.7
Jones, Cap. 5
Wooldridge (2002), 15.9
+notes de classe

Tema 4: Models amb la variable depenent limitada

Cameron i Trivedi, 16.1 a 16.3
Greene, 20.2, 20.3.1 a 20.3.3
Wooldridge (2010a), 17.2 i 17.4
Wooldridge (2002), 16.1 a 16.6
+notes de classe

Tema 5: Models de selecció de la mostra

Cameron i Trivedi, 16.5, 16.6,
Greene, 20.4.1 a 20.4.4
Jones, Cap. 7 i Cap. 8
Wooldridge (2010a), 17.5
Wooldridge (2002), 17.1 a 17.4.1
+notes de classe

Tema 6: Models d'avaluació de polítiques públiques

Cameron i Trivedi, 25.1 a 25.3, 25.5
GARCIA-PEREZ, JI (ed), cap 1 i 2
+ notes de classe

Tema 7: Models amb dades de recompte

Cameron i Trivedi, 20.1 a 20.4
Greene, 19.9
Jones, Cap. 9
Wooldridge (2010a), 17.3
Wooldridge (2002), 19.1 a 19.3
+notes de classe

Tema 8: Models amb dades de panell

Cameron i Trivedi, 21.1 a 21.10
Greene, 14.1 a 14.4
Gujarati, Cap. 16
Stock i Watson, cap. 10
Wooldridge (2010a), Cap. 13 i Cap. 14
Wooldridge (2002), Cap. 10
+notes de classe

Tema 9: Introducció a *Big data in economics*

+notes de classe
+Lectures recomendades:
-Varian, Hal R. 2014. "Big Data: New Tricks for Econometrics."
Journal of Economic Perspectives, 28(2): 3-28.
-Liran Einav, Jonathan D. Levin, The Data Revolution and
Economic Analysis, NBER Working Paper No. 19035

Calendari de sessions

Setmana 1 (12-13E)

Classes magistrals: Tema 1

Setmana 2 (19-20E)

Classes magistrals: Tema 2

Setmana 3 (26-27E)

Classes magistrals: Tema 3

Setmana 4 (2-3F)

Classes magistrals: Tema 4

Seminari: Llista 1, Lectura 1

Setmana 5 (9-10F)

Classes magistrals: Tema 5

Seminari: Llista 2, Lectura 2

Setmana 6 (16-17F)

Classes magistrals: Tema 6

Seminari: Llista 3, Lectura 3

Setmana 7 (23-24F)

Classes magistrals: Tema 7

Seminari: Llista 4, lectura 4

Setmana 8 (2-3M)

Classes magistrals: Tema 8-part 1

Seminari: Llista 5, lectura 5

Setmana 9 (9-10M)

Classes magistrals: Tema 8-part 2

Seminari: Llista 6, lectura 6

Setmana 10 (16-17M)

Classes magistrals: Tema 9 i repàs