

Universidad Autónoma de Coahuila
Centro de Investigaciones Socioeconómicas
Maestría en Economía Regional
Econometría Avanzada

Dr. Gustavo Félix Verduzco

Objetivos

1. Que el estudiante entienda, desarrolle, estime e interprete modelos econométricos a partir del análisis del problema de investigación y del tipo de datos disponibles:
 - Modelos 1 a 9: cuando los valores de la variable dependiente están limitados de manera natural.
 - Modelo 10: cuando existen efectos heterogéneos que provienen de distintos niveles de información y/o agrupamientos.
 - Modelo 11: cuando existen efectos dinámicos en estructuras de panel de datos con N grande y T pequeño.
2. Que el estudiante entienda y practique el uso de un Software para estimar los modelos.

Temas

1. Introducción
2. Modelos de elección binaria
 - Variable dependiente dicotómica
3. Modelo Logit Condicional
 - Variable dependiente dicotómica con efectos condicionados a las características de las alternativas disponibles
4. Modelos bivariados y trivariados
 - Interrelación de dos o tres ecuaciones con variable dependiente dicotómica
5. Modelo Multinomial
 - Variable dependiente con más de dos valores categóricos no ordenados
6. Modelo Logit Anidado
 - Variable dependiente categórico con alternativas anidadas
7. Modelos con variable dependiente ordenada
 - Variable dependiente con más de dos valores categóricos ordenados
8. Modelo Poisson
 - Variable dependiente que expresa el número de ocurrencias de un evento
9. Modelos de duración (supervivencia)
 - Variable dependiente que refleja el tiempo de supervivencia del sujeto u objeto de investigación
10. Modelos lineales multinivel.
 - Modelos que estiman los efectos que varían en más de un nivel de la información o agrupamiento.
11. Modelos dinámicos lineales de panel de datos.
 - Modelos lineales con estructura de panel que incorporan los efectos dinámicos autorregresivos de la variable dependiente.

Bibliografía:

- Cameron A.C. and P.K. Trivedi. 2005. *Microeconometrics. Methods and Applications*. Cambridge University Press.
- Gelman, A., y Hill, J., 2015, *Data analysis using regression and multilevel/hierarchical models*, Cambridge University Press, United Kingdom, 13th printing 2015.
- Greene, W. H. *Econometric Analysis*.
- Kenneth, E. Train (2002). *Discrete Choice Methods with Simulation*. Cambridge University Press. Este libro lo proporcionará el maestro mediante un archivo en el aula virtual.
- Wooldridge, J. M. (2001). *Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data*. The MIT Press. Capítulos 15, 16 y 19.

Evaluación

1. (20%) Reproducción de ejercicios en STATA. El documento a entregar debe contener:
 - Problema de investigación
 - Descripción del modelo y de los datos
 - Síntesis sobre interpretación y presentación de resultados
2. (20%) Síntesis de comprensión de artículos donde se utilizan los modelos estudiados. Cada documento debe contener lo siguiente:
 - Ficha bibliográfica del artículo
 - Problema de investigación que se intenta responder con el análisis econométrico (máximo ½ cuartilla)
 - Descripción del modelo y de los datos utilizados (máximo 1 cuartilla)
 - Síntesis sobre interpretación y presentación de resultados econométricos (máximo 1 cuartilla)
3. (30%) Trabajo final de libre elección, donde se proponga y estime un modelo visto durante el curso.
4. (30%) Examen final para responder en casa.

Forma de trabajo

Es obligatorio leer los temas antes de cada clase.

El profesor expondrá los elementos básicos sobre cada tema y también explicará el uso aplicado de cada modelo utilizando para ello un software especializado.

Los alumnos expondrán la comprensión de artículos donde se utilicen los modelos estudiados.

Los alumnos expondrán los resultados de su trabajo final.