



FICHA IDENTIFICATIVA

DATOS DE LA ASIGNATURA

Código: 44953

Nombre: Microeconometría

Ciclo: Máster Universitario Oficial

Créditos ECTS: 5

Curso académico: 2026-27

TITULACIONES

Titulación	Centro	Curso	Periodo
2242 - Máster Universitario en Economía	Facultat d'Economia	1	Segundo cuatrimestre

MATERIAS

Titulación	Materia	Carácter
2242 - Máster Universitario en Economía	Materia instrumental	OPTATIVA

COORDINACIÓN

SANCHIS LLOPIS JUAN ALBERTO

ROCHINA BARRACHINA MARIA ENGRACIA

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.

rte 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 / RESULTADOS DE APRENDIZAJE

2242 - Máster Universitario en Economía

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.

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

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 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 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.

DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS

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. 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.
 - 1.3.5. 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 (HORAS)

ACTIVIDADES PRESENCIALES

Actividad	Horas
Teoría	40,00
Prácticas en aula	10,00
Total horas	50,00

ACTIVIDADES NO PRESENCIALES

Actividad	Horas
Asistencia a otras actividades	5,00
Elaboración de trabajos individuales o en grupo	10,00
Estudio y trabajo autónomo	35,00
Preparación de clases	25,00
Preparación de actividades de evaluación	0,00
Resolución de casos prácticos	0,00
Total horas	75,00

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.

eminarios académicos.p>

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.

n>

BIBLIOGRAFÍA



- 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.
- 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.