

**FITXA IDENTIFICATIVA****DADES DE L'ASSIGNATURA****Codi:** 44953**Nom:** Microeconometria**Cicle:** Màster Universitari Oficial**Crèdits ECTS:** 5**Curs acadèmic:** 2025-26**TITULACIONS**

Titulació	Centre	Curs	Període
2242 - Màster Universitari en Economia	Facultat d'Economia	1	Segon quadrimestre

MATÈRIES

Titulació	Matèria	Caràcter
2242 - Màster Universitari en Economia	Materia instrumental	OPTATIVA

COORDINACIÓ

SANCHIS LLOPIS JUAN ALBERTO

ROCHINA BARRACHINA MARIA ENGRACIA

RESUM

La Microeconometria és una assignatura del segon semestre del Màster en Economia. L'objectiu d'aquesta assignatura és proporcionar als economistes els coneixements suficients dels temes més actualitzats en microeconometria perquè puguin seleccionar els estimadors més apropiats i aprofitar tant les bases de dades com els models econòmics.

El programa està dissenyat per respondre a les necessitats dels investigadors i professionals en treballar amb dades reals, on una dimensió important en la unitat d'anàlisi és l'individu. Això requereix l'ús de microdades i l'aplicació de tècniques avançades en (micro)econometria.

El contingut pràctic d'aquest curs té dos objectius: d'una banda, el coneixement i ús del paquet estadístic-economètric STATA; d'altra banda, i en cada un dels temes, ser capaç de resoldre casos pràctics que requereixin l'ús dels diferents estimadors explicats en la part teòrica del programa.

CONEIXEMENTS PREVIS**RELACIÓ AMB ALTRES ASSIGNATURES DE LA MATEIXA TITULACIÓ**



No s'ha especificat restriccions de matrícula amb altres assignatures del pla d'estudis.

ALTRES TIPUS DE REQUISITS

No hi ha restriccions d'inscripció especificades amb altres assignatures del currículum.

L'econometria del primer semestre del Màster en Economia.

COMPETÈNCIES / RESULTATS D' APRENTATGE

-

Posseir i comprendre coneixements que aportin una base o oportunitat de ser originals en el desenvolupament i / o aplicació d'idees, sovint en un context de recerca.

Que els estudiants posseïsquen les habilitats d'aprenentatge que els permeten continuar estudiant d'una forma que haurà de ser en gran manera autòdrida o autònoma.

Que els estudiants sàpiguen aplicar els coneixements adquirits i la seua capacitat de resolució de problemes en entorns nous o poc coneguts dins de contextos més amplis (o multidisciplinaris) relacionats amb la seua àrea d'estudi.

Que els estudiants sàpiguen comunicar les conclusions (i els coneixements i les raons últimes que les sustenten) a públics especialitzats i no especialitzats d'una manera clara i sense ambigüitats.

Que els estudiants siguen capaços d'integrar coneixements i afrontar la complexitat de formular judicis a partir d'una informació que, sent incompleta o limitada, incloga reflexions sobre les responsabilitats socials i ètiques vinculades a l'aplicació dels seus coneixements i judicis.

DESCRIPCIÓ DE CONTINGUTS

1. Models de dades de panell.

1.1. Efectes fixos i efectes aleatoris.

1.2. Models estàtics.

1.2.1. L'estimador d'efectes aleatoris: mínims quadrats generalitzats (GLS).

1.2.2. L'estimador d'efectes fixos: Intragrups (WG) i regressió de dummies individuals.

1.2.3. Efectes aleatoris versus efectes fixos: prova de Hausman.

1.2.4. Algunes extensions de variables instrumentals (IV) per als estimadors aleatoris i efectes fixos.

1.3. Models dinàmics.

1.3.1. Problemes a l'estimació de models dinàmics amb dades de panell.

1.3.2. L'estimador d'Arellano i Bond: Una aplicació de l'estimador del Mètode Generalitzat de Moments (GMM).

1.3.3. La prova de Sargan de sobreidentificació de restriccions.

1.3.4. La prova de correlació errors idiosincràtics.

1.3.5. L'estimador d'Arellano i Bover, i el de Blundell i Bond: l'estimador del Mètode Generalitzat de Moments del Sistema (Sistem-GMM).



2. Models de selecció discreta.

- 2.1. Introducció.
- 2.2. Models de resposta binomial: el model de probabilitat lineal per a resposta binària; i, els models Probit i Logit. Estimació per màxima versemblança.
- 2.3. Reportant els resultats per a Probit i Logit.
- 2.4. Models de selecció discreta multinomial: models no ordenats (logit multinomial), models de selecció probabilística (logit multinomial condicional) i models no ordenats.

3. Models de variable dependent censurada.

- 3.1. Introducció.
- 3.2. El model Tobit.
- 3.3. Estimació i inferència del model Tobit.
- 3.4. Reportant els resultats.
- 3.5. Mètode de Heckman (models de selecció de mostra).

4. Models de dades COUNT.

- 4.1. Definició, exemples i funcions de distribució.
- 4.2. model de verí.
 - 4.2.1. Funció de distribució, propietats i supòsits.
 - 4.2.2. Estimador de màxima versemblança i consistència.
 - 4.2.3. Interpretació de coeficients: Efectes marginals.
 - 4.2.4. Principal limitació del model de Poisson, conseqüències i solucions.
- 4.3. Model binomial negatiu.
- 4.4. Models COUNT de dades ZERO INFLATED . (Zero inflated count data models.)

5. Alguns temes avançats en inferència causal.

VOLUM DE TREBALL (HORES)

ACTIVITATS PRESENCIALS

Activitat	Hores
Teoria	40,00
Pràctiques a l'aula	10,00
Total hores	50,00

ACTIVITATS NO PRESENCIALS

Activitat	Hores
Assistència a altres activitats	5,00



Elaboració de treballs individuals o en grup	10,00
Estudi i treball autònom	35,00
Preparació de classes	25,00
Preparació d'activitats d'avaluació	0,00
Resolució de casos pràctics	0,00
Total hores	75,00

METODOLOGIA DOCENT

El desenvolupament del curs està estructurat al voltant de tres elements.

En primer lloc, les lliçons teòriques, on expliquem els conceptes més importants i il·lustrem l'ús de tècniques d'anàlisi essencials. Es farà referència a la literatura més rellevant. L'assistència a aquestes classes és considerada crucial ja que garanteix una correcta transmissió del coneixement i, al mateix temps, serveix com a orientació personal per als estudiants.

En segon lloc, les classes pràctiques on resolem exercicis amb bases de dades reals i utilitzem el paquet estadístic-economètric STATA. D'aquesta manera, els estudiants tindran coneixements suficients per resoldre exercicis personals que seran lliurats durant el desenvolupament de l'assignatura.

En tercer lloc, l'estudi i la preparació de materials per part de l'estudiant, així com l'assistència a seminaris acadèmics.

grave;ncia a seminaris acadèmics.

AVALUACIÓ

La composició de la nota final d'aquest tema serà del 80% de la puntuació de l'examen i del 20% del treball desenvolupat per l'estudiant durant el curs.

BIBLIOGRAFIA

- 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.