

**FICHA DE MATERIA**

<b>DENOMINACIÓN</b>	<b>ECONOMETRIA II: MICROECONOMETRIA</b>	
<b>CRÉDITOS ECTS</b>	3	
<b>Horas lectivas</b>	24	
<b>Carácter</b>	OBLIGATORIO	
<b>Responsables</b>	Profa. Raquel Carrasco (Depto de Economía, UC3M) Prof. Ricardo Mora (Depto de Economía, UC3M)	
<b>Cuatrimestre</b>	2º	
<b>Competencias y resultados de aprendizaje que adquiere el estudiante</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>- La comprensión de trabajos empíricos que utilicen técnicas econométricas de regresión, interpretando los resultados empíricos, sus causas y consecuencias.</li> <li>- La capacidad para usar las estrategias de investigación aprendidas para abordar trabajo de investigación empírico.</li> <li>- La capacidad de uso de paquetes informáticos a nivel intermedio para la estimación de modelos con datos microeconómicos.</li> <li>- La capacidad para presentar resultados de técnicas regresión lineal a una audiencia especializada.</li> <li>- La capacidad para evaluar críticamente el trabajo empírico de investigación en economía y el diseño de nuevo trabajo de investigación.</li> <li>- Se pretende reforzar el interés del estudiante para acometer retos de investigación y aportar estrategias de resolución de problemas empíricos con datos económicos.</li> </ul>		
<b>Requisitos previos</b>	No se han establecido	
<b>Actividades formativas, metodología de enseñanza-aprendizaje y relación con las competencias que debe adquirir el estudiante</b> <p><b>Adquisición de conocimientos teóricos a través de:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>▪ Clases magistrales en las que se desarrollara los conceptos teóricos y prácticos fundamentales que el alumno debe adquirir. Para ello se elaborara una colección apuntes y ejercicios que el alumno tendrá con antelación a las clases. Así mismo se facilitará la bibliografía de referencia, complementaria y adicional a los aspectos desarrollados en clase que se pondrá a disposición del alumno para profundizar en aquellos temas en los cuales estén más interesados.</li> <li>▪ Resolución de ejercicios y supuestos aplicados por parte del profesor, fomentando la participación activa de los estudiantes en la resolución de los mismos (tanto de forma individual como en equipo). Estos ejercicios se resolverán durante las clases magistrales.</li> </ul> <p><b>Adquisición de habilidades y destrezas a través de:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>▪ A lo largo del curso se acudirán a las aulas informáticas para introducir al alumno las herramientas informáticas de programación aplicadas a la resolución de problemas directamente relacionados con los contenidos de la asignatura.</li> <li>▪ Resolución por parte del alumno de ejercicios propuestos por el profesor que serán entregados a lo largo del curso y que servirán para autoevaluar sus conocimientos y adquirir las capacidades necesarias.</li> </ul>		

### **Sistema de evaluación y calificación**

La evaluación formativa conformará el 40% de la calificación final. Se llevará a cabo a través de:

- Participación en clase: **20%**. Se valorarán las intervenciones concisas, que conecten con las ideas que se han estado exponiendo y que aporten valor añadido a la discusión. A tal fin, el profesor pondrá en debate una cuestión teórica, un problema de programación práctico, etc.
- Resolución de ejercicios: **20%**. Se presentarán al profesor en los momentos establecidos. El profesor los devolverá corregidos y comentados. Normalmente, estos ejercicios se tendrán que hacer individualmente.

El examen final supondrá el resto de la calificación (**60%**). Constará de un examen escrito teórico y práctico para valorar el grado en que el estudiante ha adquirido las competencias establecidas.

Todo ello de acuerdo con la legislación vigente.

### **Breve descripción de contenidos**

Los contenidos teóricos de esta materia pueden resumirse en los siguientes puntos:

- Análisis de Regresión Simple: Interpretación de la regresión MCO. Sesgo de variable omitida. Desviaciones típicas de los estimadores MCO.
- Inferencia: Consistencia y normalidad asintótica. La  $t$  de Student. El contraste  $F$ . Eficiencia Asintótica. Inferencia robusta a la heteroscedasticidad.
- Variables instrumentales: Motivación. El estimador IV. 2SLS. Soluciones IV en problemas de variables medidas con error. Contrastes de endogeneidad.
- Panel de datos con dos periodos: Secciones cruzadas con varios periodos. Panel de datos. Evaluación de políticas económicas con datos de panel con dos periodos.

### **Bibliografía básica**

- Wooldridge, J.M. Introducción a la Econometría: Un Enfoque Moderno. Paraninfo Thompson Learning
- Wooldridge, J.M. Introductory Econometrics. A Modern Approach. South-Western College Publishing
- Goldberger, A.S. Introducción a la Econometría. Ariel
- Goldberger, A.S. Introductory Econometrics Harvard University Press