

# CURSO DE DATOS DE PANEL CON STATA® 18

## Fechas del curso y profesorado:

Profesora: María Engracia Rochina (Catedrática en la Universidad de Valencia)

Jueves 11 de abril: 15.00 a 17.00 horas.

Viernes 12 de abril: 15.00 a 17.00 horas.

Jueves 18 de abril: 15.00 a 19.00 horas.

Profesor: Juan Alberto Sanchís-Llopis (Catedrático en la Universidad de Valencia).

Viernes 19 de abril: 15.00 a 18.00 horas.

Jueves 25 de abril: 15.00 a 18.00 horas.

Viernes 26 de abril: 15.00 a 17.00 horas.

**Lugar de celebración:** Curso online impartido por videoconferencia a través del aula virtual de la Universidad de Alcalá.

## Objetivo

El curso trata de proporcionar a los estudiantes los conocimientos necesarios para la estimación de modelos lineales con datos de panel y de algunos modelos no lineales con datos de panel, con la finalidad de que puedan elegir los estimadores más apropiados, aplicarlos e interpretarlos. El programa está diseñado para responder a las necesidades de los investigadores y profesionales cuando trabajan con datos de panel, donde una dimensión importante en el análisis es el individuo o la empresa. Esto requiere el uso de microdatos y el uso de técnicas de la (micro) econometría.

El contenido práctico de este curso tiene como objetivos, por un lado, el manejo del paquete estadístico-econométrico STATA para la estimación de modelos para datos de panel y, por otro lado, la ilustración de cómo se resuelven por los distintos estimadores los distintos problemas econométricos que nos aparecen en los datos de panel y sus modelos.

## Planteamiento

El núcleo de la actividad es un curso virtual/*webinar*, en directo, impartido a través del sistema de videoconferencia del **aula virtual de la Universidad de Alcalá**

## Programa

### PARTE I. MODELOS LINEALES CON DATOS DE PANEL

Día 11 de abril (María E. Rochina)

15:00-17:00 Modelos de efectos fijos y aleatorios. Estimación de modelos estáticos: estimación del modelo de efectos aleatorios (Mínimos cuadrados generalizados); estimación del modelo de efectos fijos bajo exogeneidad estricta; el estimador intragrupos y el estimador de dummies individuales; efectos aleatorios *versus* efectos fijos; contraste de especificación "tipo Hausman". Extensiones de los estimadores de efectos aleatorios (MCG) y de efectos fijos (IG) a métodos de variables instrumentales.

Día 12 de abril (María E. Rochina)

15:00-17:00 Prácticas con modelos estáticos.

Día 18 de abril (María E. Rochina)

15:00-19:00 Estimación de modelos dinámicos: problemas de estimación; el estimador Anderson y Hsiao; el estimador de Arellano Bond; método generalizado de momentos. Test de Sargan. Test de correlación serial de segundo orden de los residuos. El estimador de Arellano y Bover, y de Blundell y Bond: El Método Generalizado de Momentos Sistema (System-GMM).

Prácticas con modelos dinámicos.

### PARTE II. MODELOS NO LINEALES CON DATOS DE PANEL

Día 19 de abril (Juan A. Sanchis)

15:00-18:00 El modelo de elección discreta binomial con datos de corte transversal y con datos de panel. Prácticas con modelos de elección discreta binomial con datos de panel.

Día 25 de abril (Juan A. Sanchis)

15:00-18:00 Los modelos de elección discreta multinomial no-ordenados y ordenados con datos de corte transversal y con datos de panel. Prácticas con modelos de elección discreta multinomial no-ordenados con datos de panel.

Día 26 de abril (Juan A. Sanchis)

15:00-17:00 El modelo de variable dependiente censurada para datos de corte transversal y para datos de panel: tobit. Prácticas con modelos de variable dependiente censurada con datos de panel.

## Profesorado



**María Engracia Rochina** es Catedrática de Economía Aplicada en el Departamento de Estructura Económica de la Universidad de Valencia. La profesora Rochina obtuvo el Máster y el Doctorado en Economía por la University College London (The University of London), en 2000. Actualmente, pertenece al grupo de investigación "Social and Economic Behaviour (ERI-CES)", que consiste en un grupo de investigación interdisciplinar de la Universidad de Valencia. Sus principales áreas de investigación son la microeconometría aplicada, la organización industrial aplicada y la economía internacional aplicada. En particular, su línea de investigación principal se centra en el análisis la dinámica de las empresas en términos de innovación e internacionalización, productividad de las empresas, y entrepreneurship. Sus trabajos han sido publicados en diferentes revistas académicas entre las que se encuentran, *Journal of Industrial Economics*, *International Journal of Industrial Organization*, *Oxford Economic Papers*, *Technological Forecasting and Social Change*, *Industry and Innovation*, *Industrial and Corporate Change*, *The Econometrics Journal*, *Review of World Economics*, *World Economy*, *Small Business Economics*, y *Empirical Economics*, entre otras. Igualmente, ha sido responsable y/o ha participado en un buen número de proyectos competitivos nacionales (Ministerio de Ciencia y Tecnología) e internacionales (European Commission, BBVA foundation y World Bank).



**Juan Alberto Sanchís-Llopis** es Catedrático de Economía Aplicada en el Departamento de Economía Aplicada de la Universidad de Valencia. Máster y Doctor por el University College London (UK). Actualmente, es director del grupo de investigación "Social and Economic Behaviour (ERI-CES)", que consiste en un grupo de investigación interdisciplinar de la Universidad de Valencia. Sus principales áreas de investigación son la microeconometría aplicada, la organización industrial aplicada y la economía internacional aplicada.. Su línea de investigación principal se centra en el ámbito de la economía industrial y más concretamente en el análisis de las decisiones estratégicas de las empresas en términos de I+D y de orientación exportadora. Su producción científica incluye artículos publicados en the *Journal of Industrial Economics*, *the Industrial and Corporate Change*, *the World Economics*, *Empirica*, *the Review of Industrial Organization* y the *Small Business Economics*, entre otras. Finalmente, ha sido responsable y/o ha participado en un buen número de proyectos competitivos nacionales (Ministerio de Ciencia y Tecnología) e internacionales (European Commission, BBVA foundation y World Bank).