

<p>Econometría de Datos Panel</p> <p>Propuesta FE-UNAM Licenciatura en Economía (borrador)</p> <p>Asignatura Optativa</p> <p>Unidad I. Modelos tradicionales</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Introducción: ¿por qué datos panel? 2. Modelo estático y modelo dinámico 3. Modelo panel en dos periodos de tiempo 4. El modelo panel lineal general 5. Métodos de estimación <ol style="list-style-type: none"> 5.1. Intercepto común 5.2. Efectos fijos 5.3. Efectos aleatorios 5.4. Efectos fijos versus efectos aleatorios 5.5. Modelo SUR <p>Unidad II. Generalidades e Inferencia</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Efectos individuales y efectos tiempo 2. Panel de datos balanceado 3. Panel de datos no balanceado 4. Inferencia <ol style="list-style-type: none"> 4.1. Prueba de Hausman 4.2. Prueba de Breusch-Pagan 	<p>Unidad III. Panel dinámico con heterogeneidad</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Modelo con correlación serial 2. Modelo con dependencia de estado 3. Sesgo en el panel dinámico <ol style="list-style-type: none"> 3.1. Sesgo en el estimador de mínimos cuadrados ordinarios 3.2. Sesgo en el modelo de efectos fijos 3.3. Sesgo en el modelo de efectos aleatorios 4. Soluciones al problema de sesgo, naturaleza dinámica del panel <ol style="list-style-type: none"> 4.1. Sesgo debido a pendientes heterogéneas en el panel dinámico 5. Soluciones al sesgo por heterogeneidad, métodos alternativos de estimación <ol style="list-style-type: none"> 5.1. Estimadores de medias por grupos <p>Unidad IV. Panel no estacionario</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. No estacionariedad y cointegración en datos panel 2. Pruebas de raíces unitarias <ol style="list-style-type: none"> 2.1. Prueba de Levin-Lin 2.2. Prueba de Im, Pesaran y Shin 2.3. Prueba de Maddala y Wu 3. Pruebas de cointegración <ol style="list-style-type: none"> 3.1. Prueba de Kao 3.2. Prueba de McCoskey y Kao 3.3. Prueba de Pedroni 3.4. Prueba de Larsson, Lyhagen y Lothgren
---	--

Bibliografía

Asteriou [Capítulos 18,19 y 20] ; Brooks [Capítulo 10] ; Baltagi ; Maddala [Cap. 15] ; Ruud ; Stock Watson [Cap. 8] ; Wooldridge, Cross section and panel data