

Algunas técnicas econométricas con aplicación a temas de economía de la empresa y marketing

José M. Labeaga, UNED
Marzo-Abril, 2018

Clase 1. Estimación de modelos discretos

- Estadísticos descriptivos e inferencia causal
- Qué queremos medir y alternativas para su medición
- Ejemplos de experimentos y cuasiexperimentos en ciencias sociales
- Caso 1

Referencias básicas

Cerulli, G. (2015). *Econometric Evaluation of Socio-Economic Programs. Theory and Applications*. Springer, Rome.

Heckman, J. J. (2001). "Micro data, heterogeneity, and the evaluation of public policy: Nobel Lecture", *Journal of Political Economy*, 109, 673-748.

Referencias adicionales

Chintagunta, P. K. and H. S. Nair (2011). "Discrete-choice models of consumer demand in marketing", *Marketing Science*, 30, 977-996.

Clase 2. Algunos métodos para tratar modelos con selección

2.1. Métodos de selección basados en observables

- Regresión múltiple
- Métodos de apareamiento (matching)
- Caso 2

2.2. Métodos de selección basados en no observables

- Diferencias de diferencias
- Variables instrumentales
- Caso 3

Referencias básicas

Cerulli, G. (2015). *Econometric Evaluation of Socio-Economic Programs. Theory and Applications*. Springer, Rome.

Angrist, J. D. y J. S. Pischke (2015). *Mastering Metrics. The Path from Cause to Effect*. Princeton University Press, New Jersey.

Rubin, D. B. (2001). "Using propensity scores to help design observational studies: Application to the tobacco litigation", *Health Services and Outcomes Research Methodology*, 2, 269-188.

Referencias adicionales

Shipman, J. E., Q. T. Swanquist y R. L. Whited (2017). "Propensity score matching in accounting research", *The Accounting Review*, 92, 213-244.

Oh, I., J. D. Lee, A. Heshmati y G. G. Choi (2009). "Evaluation of credit guarantee policy using propensity score matching", *Small Business Economics*, 33, 335-351.

Clase 3. Métodos para modelos no lineales

- Modelos censurados y truncados
- El modelo de Heckman
- Modelos no lineales con datos de panel
- Caso 4

Referencias básicas

Arellano, M. (2003). "Discrete choices with panel data", *Investigaciones Económicas*, 27, 423-458.

Wooldridge, J. M. (2010). *Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data*. The MIT Press, Cambridge, MA.

Referencias adicionales

Alessie, R., S. Hochguertel y A. van Soest (2004). "Ownership of stocks and mutual funds: A panel data analysis", *Review of Economics and Statistics*, 86, 783-796.

Labeaga, J. M. Martínez-Ros, E. y P. Mohnen (2017). "Tax incentives and firm size: Effects on private R&D investment in Spain", manuscrito.