

## MODELOS CON DATOS DE PANEL

### DIRECTOR DEL CURSO

José Alberto Plaza Tejera. Director General del Instituto de Estudios Fiscales.

### COORDINADOR DEL CURSO

César Pérez López. Vocal Asesor del Instituto de Estudios Fiscales.

### OBJETIVOS DEL CURSO

Los paneles de datos constituyen un tipo especial de muestras en las que se sigue el comportamiento de un cierto número de agentes económicos a través del tiempo. De esta forma, el investigador puede realizar análisis económico y especificar modelos con los datos de sección cruzada (o de corte transversal) que se obtienen cuando se consideran todos los agentes económicos en un instante del tiempo. Alternativamente, se pueden realizar los mismos análisis considerando la serie temporal dada por la evolución de cada agente económico a lo largo de todos los períodos de tiempo de la muestra. En este último caso podrían examinarse diferentes pautas de comportamiento individuo a individuo en todo el intervalo temporal de la muestra. Por lo tanto, una característica esencial de la estructura de datos de panel es su bidimensionalidad. Una dimensión la constituye la lista de individuos y otra dimensión la forman los instantes de tiempo. Los modelos con datos de panel consideran simultáneamente ambas dimensiones. Este curso trata una amplia tipología de modelos econométricos con datos de panel estáticos y dinámicos, presentando gran variedad de ejercicios resueltos utilizando el software más actual para paneles como son los programas EVIEWS, SAS, IBM SPSS y STATA.

### PROGRAMA

- Introducción a los modelos con datos de panel
- Estructuras de datos: paneles puros y paneles expandidos, comparación entre combinaciones de cortes transversales (pool de datos) y paneles
- Modelos econométricos con datos de panel
- Modelos de panel con coeficientes constantes
- Modelos de panel de efectos fijos
- Modelos de panel de efectos aleatorios
- Autocorrelación y heteroscedasticidad en modelos con datos de panel
- Modelos dinámicos con datos de panel: Metodología de Arellano Bond
- Modelos logit y probit con datos de panel
- Estabilidad de modelos con datos de panel. Cambio estructural, raíces unitarias y cointegración en paneles
- Modelos de datos de panel con EVIEWS, STATA y SAS

### PROFESORADO

**Ignacio Moral Arce.** Autoridad Independiente de Responsabilidad Fiscal (AIREF).



## FECHAS

DÍAS 4, 5, 11, 12, 18 y 19 de diciembre de 2017, en horario de 16 a 20 horas. Aula 2.12. Edificio A. Segunda Planta.

## INFORMACIÓN Y MATRÍCULA

Instituto de Estudios Fiscales:

[http://www.ief.es/investigacion/cursos\\_seminarios/cursos\\_economia\\_publica.aspx](http://www.ief.es/investigacion/cursos_seminarios/cursos_economia_publica.aspx)

Avda. del Cardenal Herrera Oria, 378 – 28035 Madrid

Teléfono 00 34 91 339 87 31

Liliana Pacheco Martínez ([liliana.pacheco@ief.minhafp.es](mailto:liliana.pacheco@ief.minhafp.es))

## COORDINACIÓN ADMINISTRATIVA DE LOS CURSOS

Teléfono 00 34 91 339 54 43

Liliana Pacheco Martínez ([liliana.pacheco@ief.minhafp.es](mailto:liliana.pacheco@ief.minhafp.es))

## COSTE

Coste de cada curso: 360 euros (con reducciones del 50% del importe total para funcionarios, universitarios y licenciados en paro, estudiantes de doctorado, becarios y similares siempre que acrediten dicha condición). Los funcionarios del Ministerio de Hacienda y Función Pública y del Ministerio de Economía, Industria y Competitividad están exentos de tasas.

La matrícula definitiva al curso para los alumnos que no pertenezcan al Ministerio de Hacienda y Función Pública y del Ministerio de Economía, Industria y Competitividad está supeditada al pago de los derechos de inscripción que se abonarán por transferencia bancaria. **El número de cuenta se facilitará en la Notificación de Admisión que será enviada a los alumnos admitidos una vez haya finalizado el proceso de selección.**

La no asistencia al curso que no haya sido notificada podrá ser causa de exclusión en posteriores adjudicaciones de cursos.