



Descriptivo

# Revisión de Corte Transversal y Modelación de Datos Panel Dinámicos. Autores: Miguel Bello y Eliana Franco.

## Descripción:

Se realizará una descripción aplicada del uso de la herramienta de análisis, mediante la estimación e interpretación de resultados, en casos de Modelos Económicos Lineales con Datos Panel. Durante el Entrenamiento, los participantes resolverán casos y trabajos tanto individuales como grupales, permitiendo familiarizarse con el uso de las herramientas de análisis revisadas. Es recomendable que los participantes cuenten con conocimientos básicos de econometría y que tengan alguna experiencia previa con herramientas de análisis estadístico.



Dirigido a:

Brindar la información necesaria para que, al finalizar el taller, los participantes puedan analizar Bases de Datos Panel, Estimar e Interpretar los resultados de Modelos Econométricos Dinámicos mediante el uso del paquete estadístico Stata.



Objetivo:

Directores, Analistas en los Sectores Público y Privado. Responsables y Analistas de Políticas Públicas. Docentes, Investigadores y Profesionales, que en sus labores requieran aplicar Métodos Estadísticos y Econométricos para el Análisis de Información.



Temario:

Manejo y Análisis de Bases de Datos Se explicarán los principales conceptos para el manejo adecuado de las Bases de Datos, para luego pasar al Análisis y Exploración de tipo Descriptivo e Inferencial. Importación y Exportación de Bases de Datos. Describir una Base de Datos (Describe, Codebook, Inspect) Crear y Transformar Variables (Formatos y Tipos de Variables) Ordenar, Transponer, Colapsar Variables y Bases de Datos Pegar Bases de Datos de manera Horizontal y Vertical (Merge y Append) Recodificación de Variables Crear Variables Dummy Manejo de Datos Duplicados y Filtros Estadísticas Descriptivas (Momentos de una Distribución de Probabilidad) Generación de Tabulados de Variables y Tablas Estadísticas Tablas Descriptivas Tablas de Frecuencias Tablas Estadísticas (Promedio, Cuenta, Desviación Estándar, etc.) Matriz de Correlación / Covarianza y Significancia Estadística Pruebas de Hipótesis sobre la Media y la Varianza (Univariado y Bivariado). Gráficos Básicos (Dispersión, Matricial, Torta, Caja o Bigotes, Barras) Regresión Lineal Múltiple - Aspectos Básicos Partiendo de que los asistentes cuentan con la base teórica, se realizarán ejercicios para la Estimación de Modelos Lineales de Regresión Múltiple, Identificación de la Violación de los Supuestos MCO y Comandos Básicos para su corrección. Estimación de la Matriz de Correlación entre Variables y Significancia Estadística Estimación del Modelo Estándar de Regresión Lineal MCO (Regress) Pruebas de Hipótesis sobre los Parámetros (Test) Multicolinealidad, Heterocedasticidad y Pruebas de Normalidad Pronóstico Modelos Lineales con Data Panel - Aspectos Básicos En esta sección, el trabajo se enfocará a la distinción esencial de Métodos de Estimación para Modelos de Efectos Fijos y Modelos de Efectos Aleatorios. Introducción. Tipos de Panel Data (Panel Corto y Panel Largo). Conversión de la Presentación de los Datos Panel - (Wide a Long y viceversa) Descripción de Datos, Estadísticas Básicas, Listado de Variables, Identificadores de Tiempo y de Panel. Evaluación de la importancia relativa de la variación intra-grupos (within) y entre-grupos (between), para cada variable. Probabilidad de transición de un período a otro, para cada variable (xttrans). Modelos de Efectos Fijos (within) Modelos Efectos Agrupados (between) Modelos de Efectos Aleatorios. Estimación de Efectos Fijos y Efectos Aleatorios Modelos de Efectos Fijos y Estimación MCO con Dummies. Estimación en Primeras Diferencias. Consideraciones para estimar Modelos Econométricos con Panel Largo. Estimación, Validación, Interpretación de Resultados y Predicción. Efectos Fijos y Efectos Aleatorios ¿Cómo elegir el Método de Estimación apropiado? (Hausman). Elaboración de Tablas con Resultados Comparativos Modelos Lineales con Data Panel - Extensiones Se presentarán Métodos de Estimación adicionales, tales como: Variables Instrumentales y Modelos con Variables Dependientes Rezagadas. En esta sección, el énfasis será puesto en la Estimación e Interpretación de Modelos Dinámicos. Estimación de un Modelo IV con Datos Panel. ¿En qué consiste un Panel Dinámico? Estimador Hausman-Taylor. Estimador Arellano-Bond. - Prueba de Sargan (Sobre-Identificación) - Prueba de Arellano-Bond (Autocorrelación) Ejercicios de Práctica Grupal e Individual.



Instructores: