

Datos de Panel

Maestrías en Economía y Econometría

Examen Final

Primer Trimestre 2025

Fecha de entrega: 14 de Julio de 2025

Estimación consistente en modelos dinámicos con sesgo de selección

Para resolver el examen primero lea el trabajo `Simple methods for consistent estimation of dynamic panel data sample selection models` de Majid al Sadoon, Sergi Jiménez-Martín, y José M. Labeaga. El trabajo se encuentra disponible en el campus virtual.

Este *working paper* se centra en la combinación de dos modelos cubiertos en el curso: paneles dinámicos y modelos con sesgo de selección. El estudio es realizado con simulaciones de Monte Carlo. En la sección 3 del trabajo se describe la generación de datos. Repita la generación utilizando como semilla los últimos 5 números de su documento de identidad o pasaporte para que los resultados sean replicables. Los valores alcanzados no coincidirán con las tablas/figuras de Sadoon et al., puesto que ellos utilizaron otro valor de semilla. Solo se busca evaluar si las implicancias de los resultados de este examen coinciden con lo hallado por los autores.

1. Reproduzca las tablas 1 a 3 del trabajo de Sadoon et al.
2. Reproduzca la figura 1 del trabajo de Sadoon et al.
3. Comente sobre el sesgo promedio de las estimaciones a medida que aumenta el valor del parámetro de persistencia ρ para ambos estimadores: Arellano-Bond y SyS. ¿Varían las conclusiones al trabajar con muestras pequeñas o grandes?

Instrucciones para la entrega

- El trabajo es individual.
- Use los últimos 5 números de su documento de identidad como *seed* en el código para que los resultados sean replicables.
- El trabajo se puede hacer en Stata, R, Matlab o similar.
- Deben entregar un archivo `.pdf` (`.doc` o similar) con un reporte de sus conclusiones y adjuntar el código (`.do`, `.r`, `.m`, etc.) o entregar el `.log` file aparte.
- En el código deberán hacer comentarios breves para que se entienda el procedimiento.
- La entrega se realizará vía Campus Virtual hasta el día **14 de julio** de 2025 a las 11:59pm.