

Título del proyecto: Métodos econométricos: Teoría y Aplicaciones en Economía Laboral y Finanzas

Referencia: ECO2014-58434-P

Entidad que concede: Ministerio de Economía y Competitividad

Investigador Principal 1: Juan Mora López

Investigador Principal 2: M<sup>a</sup> Angeles Carnero Fernández

Miembros del Proyecto:

Abad Díaz, David

Albarrán Pérez, Pedro

Balboa Ramón, Marina

Carnero Fernández, M<sup>a</sup> Angeles

Collado Vindel, M<sup>a</sup> Dolores

León Valle, Ángel Manuel

Mora López, Juan

Rubia Serrano, Antonio

**DOCTORES DEL EQUIPO DE TRABAJO:**

Messina, Julián

Battaglia, Marianna

Sanz De Galdeano Aleixandre, Anna

**No Doctores Del Equipo De Trabajo:**

Qun Cao

Girona Sánchez, José

Telek, Adam

Yu, Haihan

Periodo: de 01/01/2015 a 31/12/2017

Resumen:

Este proyecto pretende analizar aspectos teóricos y empíricos de diversos modelos econométricos de interés en Economía Laboral y Finanzas. Analizaremos los siguientes puntos:

1. Cuestiones empíricas de Economía Laboral. En particular, examinaremos el papel de los salarios mínimos como fuente de indiciación salarial en países en desarrollo; evaluaremos el efecto de los seguros de salud sobre el comportamiento individual; y analizaremos empíricamente algunos hechos que pueden afectar a la oferta y demanda de trabajo y también al comportamiento de los trabajadores en España.
2. Evaluación de programas en países en desarrollo. En particular, estudiaremos la efectividad de las microfinanzas con datos de Bangladesh; estudiaremos si la contracepción permanente e involuntaria reduce la mortalidad infantil con datos de Perú; evaluaremos el Programa Roma de Asistencia a la Educación en Serbia; y planeamos investigar el impacto de intervenciones públicas en escuelas primarias de la República Dominicana.
3. Econometría Teórica. En particular, analizaremos cómo estimar características de variables latentes a partir de datos de elección discreta ordenada; discutiremos cómo contrastar dominancia estocástica condicional restringida; y analizaremos la especificación y estimación robusta de modelos de datos financieros.
4. Econometría Financiera y Finanzas. En particular, analizaremos empíricamente los procedimientos de identificación y estimación de riesgo sistémico; discutiremos la estimación de funciones cópula y medidas de riesgo de carteras basadas en los momentos parciales menores; y discutiremos la evidencia empírica sobre las transacciones de alta frecuencia y la fragmentación de mercados.