

Models Econòmètrics**2015/2016**

Codi: 103214

Crèdits: 6

Titulació	Tipus	Curs	Semestre
2501919 Estadística Aplicada	OT	4	0

Professor de contacte

Nom: Concepció Piñol Pérez

Correu electrònic: Conxita.Pinyol@uab.cat

Utilització de llengües

Llengua vehicular majoritària: català (cat)

Prerequisites

Es recomana que l'alumne hagi cursat les assignatures de matemàtiques, d'estadística, de models lineals i **d'introducció a l'econometria** que li hagin donat coneixements en àlgebra lineal, anàlisi matricial, teoria de la probabilitat i inferència estadística, especificació, estimació i contrastació de models econòmètrics.

Objectius

L'objectiu fonamental del curs és dotar als alumnes de coneixements teòrics i pràctics de l'anàlisi i els models econòmètrics amb dades de panel, sistemes d'equacions, models dinàmics i models multiecuacionals, en general. L'alumne adquirirà la capacitat necessària per realitzar l'especificació, l'estimació i la contrastació de models i estudis econòmètrics aplicats, així com la capacitat per interpretar resultats econòmètrics.

Competències

- Analitzar les dades mitjançant l'aplicació de mètodes i tècniques estadístiques i treballar amb dades qualitatives i quantitatives.
- Desenvolupar l'interès pel coneixement i la interpretació de fenòmens susceptibles de quantificació.
- Expressar i aplicar rigorosament els coneixements adquirits en la resolució de problemes
- Identificar els models estadístics i de recerca operativa més adequats per a cada context i que permetin la presa de decisions.
- Identificar i seleccionar les fonts d'obtenció de dades i depurar-les per tractar-les estadísticament.
- Identificar la utilitat i la potencialitat de l'estadística en les diferents àrees de coneixement i saber aplicar-la adequadament per a extreure'n conclusions rellevants.
- Interpretar resultats, extreure conclusions i elaborar informes tècnics.
- Reconèixer la utilitat de la inferència estadística i de la recerca operativa i aplicar-les adequadament.
- Resumir i descobrir patrons de comportament en l'exploració de les dades.
- Utilitzar bibliografia o eines d'Internet específiques de l'estadística i d'altres ciències afins, tant en llengua anglesa com en la llengua pròpia.
- Utilitzar correctament una bona part del programari estadístic i de recerca operativa existent, escollir el més apropiat per a cada anàlisi estadística i ser capaç d'adaptar-lo a les noves necessitats.

Resultats d'aprenentatge

1. Aplicar tècniques estadístiques adequades a les dades econòmètriques.
2. Basar-se en l'exploració de les dades, en l'ajust dels models i en els resultats de la inferència per a interpretar les dades econòmètriques i extreure'n conclusions.
3. Desenvolupar l'interès pel coneixement i la interpretació de fenòmens susceptibles de quantificació.
4. Explorar les dades econòmètriques per intuir patrons de comportament.

5. Expressar i aplicar rigorosament els coneixements adquirits en la resolució de problemes.
6. Identificar els models de regressió i multivariants més utilitzats en econometria.
7. Identificar i seleccionar fonts d'informació específiques per a les anàlisis econòmètriques i depurar-ne les dades.
8. Identificar i seleccionar fonts d'informació específiques per als estudis de mercat i depurar-ne les dades.
9. Identificar les eines estadístiques específiques de les anàlisis econòmètriques i utilitzar-les de manera apropiada per a extreure'n conclusions.
10. Reconèixer la utilitat de la inferència aplicada a l'econometria.
11. Reconèixer la utilitat de la investigació operativa en la presa de decisions.
12. Ser capaç de modificar (poc o lleugerament) el programari per adaptar-lo a situacions lleugerament diferents de les estudiades.
13. Utilitzar correctament el programari propi de les anàlisis econòmètriques.
14. Utilitzar eines d'Internet i bibliografia específica d'econometria.

Continguts

(T:teoria, S: problemes o seminaris, PS:preparació de problemes o seminaris, L:laboratoris, PP:preparació pràctiques, E:estudi, AA:altres activitats; totes aquestes activitats es demanen especificades en hores.)

Tema 1: Introducció

T	S	PS	L	E	PP	AA	Total
- Què és l'econometria?							
2	1	1	0	4	0	0	8
- Models econòmics i models econòmètrics							

Tema 2: Revisió del model de regressió lineal

T	S	PS	L	E	PP	AA	Total
- Estimació, contrastació i predicció en el model de regressió lineal.							
3	4	4	0	16	0	8	40
- Correcció d'errors i problemes.							

Tema 3: Selecció del model

T	S	PS	L	E	PP	AA	Total
- Especificació i estimació de models diferents							
4	2	2	0	8	0	2	20
- Criteris de selecció de models econòmètrics							

Tema 4: Models dinàmics

T	S	PS	L	E	PP	AA	Total
- Models dinàmics i desfases							
4	2	2	0	8	0	2	20
- Anàlisi del multiplicador							
- Model Koyck							
- Retards polinomials							

Tema 5: Models amb series temporals

T	S	PS	L	E	PP	AA	Total
- Series temporals							
- Test de cointegració		3	0	12	0	6	32
- Arrels unitàries							

Tema 6: Dades de panell

T	S	PS	L	E	PP	AA	Total
0	6	3	3	12	0	6	30

- Introducció
- Estimació amb dades de panell

Metodologia

Dues hores de classes teòriques a la setmana més una de pràctiques (amb software economètric) i resolució d'exercicis relacionats amb els continguts explicats a classe per tal d'afavorir l'assimilació d'aquests coneixements per part de l'alumne

Activitats formatives

Títol	Hores	ECTS	Resultats d'aprenentatge
Tipus: Dirigides			
Problemas	16	0,64	1, 2, 3, 4, 12, 13
Teoría	32	1,28	2, 3, 6, 9, 10
Tipus: Supervisades			
Altres activitats	22	0,88	1, 2, 3, 4, 7, 13, 14
Preparación de problemas	16	0,64	1, 2, 3, 4, 5, 7, 13, 14
Tipus: Autònomes			
Estudi	64	2,56	2, 3, 6, 10, 14

Avaluació

Avaluació continuada : Sí

Els alumnes realitzaran un examen parcial, a mitjans del semestre, i un examen final, un cop finalitzat el curs. També es lliuraran llistes de problemes durant el curs i un treball final. Els alumnes lliuraran, resolts, alguns

problemes escollits d'aquestes llistes de forma regular. El 20 % de la puntuació final del curs es basarà en la resolució dels llistats d'exercicis, el 20% correspondrà al lliurament del treball final, el 20% a la nota de l'examen parcial i el 40 % en la nota de l'examen final.

Un estudiant que no hagi participat en cap de les activitats d'avaluació descrites rebrà la qualificació de "No presentat". Si un estudiant realitza alguna de les activitats d'avaluació, encara que només en sigui una, ja no pot optar a un "No presentat".

Recordeu que les assignatures de la diplomatura comparteixen docència i avaluació amb assignatures de Grau d'Estadística Aplicada i que, per tant, tots els alumnes disposen d'una única convocatòria.

Activitats d'avaluació

Títol	Pes	Hores	ECTS	Resultats d'aprenentatge
Examen final	40%	0	0	1, 2, 3, 6, 10
Examen Parcial	20%	0	0	
Resolució d'exercicis	20%	0	0	1, 2, 3, 4, 13, 14
Treball empíric	20%	0	0	1, 2, 3, 4, 6, 7, 8, 11, 13, 14

Bibliografia

- Fernández, M.D. y Llorente Marrón, M.M. "Econometría"- Ediciones Pirámide.
- Gujarati, M. "Econometría". McGrawHill
- Johnston, J. "Métodos de Econometría"- Vicens - Vives.
- Maddala, G.S. "Introducción a la Econometría"- Prentice - Hall.
- Martín, G., Labeaga, J.M. ; Mochón, F. "Introducción a la Econometría" - Prentice -Hall.
- Novales, A. "Econometría"- McGrawHill.
- Pulido, A., Pérez, J.. "Modelos Económicos: Guía para la elaboración de modelos económicos con Eviews". Ed. Pirámide
- Wooldridge, J.M. "Introducción a la Econometría: Un Enfoque Moderno" -Thomson Learning.