

Models Econòmètrics /Econometria

Codi	Tipus	Curs/semestre	Crèdits
103214 27984	Formació Bàsica / Semestral	4r/2on	6 ECTS

Professorat

Nom	Departament	Despatx	Correu electrònic	Telèfon
Inma Rico	Economia i Història Econòmica	B3-144	Inmaculada.rico@uab.cat	93 581 1719

Horari d'atenció als estudiants:

Inma Rico: Dilluns de 16:30 a 18:00
Dimecres de 16:30 a 18:00

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 generals.

Competències específiques

- CE.1: Coneixement bàsic dels fonaments teòrics i pràctics de l'anàlisi econòmètrica
- CE.2: Adquirir la capacitat per especificar, estimar i contrastar els models d'equacions simultànies i dinàmics
- CE.3: Identificar conceptes, causes i conseqüències de l'incompliment de les hipòtesis
- CE.4: Aplicar les tècniques adequades per a la validesa empírica de distintes teories econòmiques i/o empresarials
- CE.5: Maneig del software adequat (Eviews) i interpretació dels resultats

Competències genèriques

- CT1.1. Desenvolupar un pensament i un raonament crític.
- CT1.2. Desenvolupar la capacitat d'anàlisi i de síntesi.
- CT1.3. Desenvolupar el pensament científic.
- CT1.4. Desenvolupar el pensament sistemàtic.
- CT1.5. Recerca i gestió de la informació rellevant
- CT2.1. Treballar de forma autònoma.
- CT2.2. Desenvolupar estratègies d'aprenentatge autònom.
- CT2.3. Treballar en equip i cultura participativa

Capacitats prèvies

Es recomanable que l'alumne faig 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 econòmics.

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
	2	1	1	0	4	0	0	8

- ¿Què és l'econometria?
- Models econòmics i models econòmics

Tema 2: Revisió del model de regressió lineal	T	S	PS	L	E	PP	AA	Total
	8	4	4	0	16	0	8	40

- Especificació , estimació i contrastació del model de regressió lineal: simple i múltiple
- Correcció de errors i problemes

Tema 3: Selecció del model	T	S	PS	L	E	PP	AA	Total
	4	2	2	0	8	0	2	20

- Especificació i estimació de models diferents
- Criteris de selecció de models econòmics

Tema 4: Dades de panel	T	S	PS	L	E	PP	AA	Total
	6	3	3	0	12	0	6	30

- Introducció
- Estimació amb dades de panel

Tema 5: Models dinàmics	T	S	PS	L	E	PP	AA	Total
	4	2	2	0	8	0	2	20

- Models dinàmics i desfases
- Anàlisi del multiplicador
- Model Koyck
- Retards polinomials

Tema 6: Models amb series temporals	T	S	PS	L	E	PP	AA	Total
	8	3	3	0	12	0	6	32

- Series temporals
- Test de cointegració
- Arrels unitàries

Metodologia docent

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.

Avaluació

Avaluació continuada	Examen final (1a convocatòria)
<input type="checkbox"/> NO	<input type="checkbox"/> No n'hi ha
<input checked="" type="checkbox"/> SÍ	<input type="checkbox"/> Només per als estudiants que compleixin les condicions següents:
	<input checked="" type="checkbox"/> Obligatori per a tothom

Els alumnes realitzaran 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 30% correspondrà al lliurament del treball final, i el 50 % en la nota de l'examen final.

Donada la naturalesa obligatòria de l'examen final, aquells alumnes que no es presentin al mateix obtindran una qualificació de "no presentat" tot i haver entregat les llistes de problemes i/o el treball final

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.

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.