

Guia docent de l'assignatura "Introducció a l'Econometria"

2011/2012

Codi: 103177

Crèdits ECTS: 6

Titulació	Pla	Tipus	Curs	Semestre
2501919 Estadística Aplicada	973 Graduat en Estadística Aplicada	OB	3	2

Contacte

Nom : Inmaculada Rico Delgado

Email : Inmaculada.Rico@uab.cat

Utilització d'idiomes

Llengua vehicular majoritària: espanyol (spa)

Algun grup íntegre en anglès: No

Algun grup íntegre en català: Sí

Algun grup íntegre en espanyol: No

Prerequisits

Es recomana que l'alumne faig cursat les assignatures de matemàtiques, d'estadística i de models lineals que li hagin donat coneixements en àlgebra lineal, anàlisi matricial, teoria de la probabilitat i inferència estadística (estimació i contrastació d'hipòtesis).

Objectius i contextualització

L'objectiu fonamental del curs és dotar als alumnes de coneixements bàsics (teòrics i pràctics) de l'anàlisi economètrica de models uniecuacionals. L'alumne adquirirà la capacitat necessària per realitzar l'especificació, l'estimació i la contrastació de models i estudis economètrics aplicats, així com la capacitat per interpretar resultats economètrics generals.

Competències i resultats d'aprenentatge

2265:E01 - Identificar i seleccionar les fonts d'obtenció de dades i depurar-les per tractar-les estadísticament.

2265:E01.18 - Identificar les fonts d'informació més importants en estadística oficial i econometria.

2265:E02 - Dissenyar enquestes i explotar bases de dades.

2265:E02.10 - Gestionar i explotar bases de dades disponibles en els instituts d'estadística.

2265:E03 - Seleccionar el tipus de mostreig apropiat per a l'estudi.

2265:E03.08 - Seleccionar el tipus de mostreig apropiat en el context de l'estadística oficial i l'econometria.

2265:E06 - Reconèixer la utilitat de la inferència estadística i de la recerca operativa i aplicar-les adequadament.

2265:E06.19 - Reconèixer la utilitat de la inferència estadística per a l'estadística oficial i l'econometria.

2265:E07 - Analitzar les dades mitjançant l'aplicació de mètodes i tècniques estadístiques i treballar amb dades qualitatives i quantitatives.

2265:E07.20 - Analitzar dades d'estadística oficial i econometria treballant amb dades qualitatives i quantitatives.

2265:E09 - Identificar els models estadístics i de recerca operativa més adequats per a cada context i que permetin la presa de decisions.

2265:E09.19 - Identificar els models estadístics més importants en econometria i aplicar-los.

2265:E13 - 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.

2265:E13.07 - Identificar la utilitat dels coneixements estadístics en bioinformàtica, ciències de la salut, econometria, estadística industrial i estadística oficial.

2265:E14 - Utilitzar bibliografia o eines d'Internet específiques de l'estadística i d'altres ciències afins, tant en llengua anglesa com en la llengua pròpia.

2265:E14.07 - Identificar la bibliografia i els recursos propis de les aplicacions de l'estadística en bioinformàtica, ciències de la salut, econometria, estadística industrial i estadística oficial.

2265:T05 - Coordinar i treballar en equip amb grups potencialment multidisciplinaris.

2265:T05.00 - Coordinar i treballar en equip amb grups potencialment multidisciplinaris.

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	2	2	0	4	0	0	10

- ¿Què és l'econometria?
- Models econòmics i models economètrics
- Les sèries econòmiques i la seva problemàtica

Tema 2: El model de regressió lineal

T	S	PS	L	E	PP	AA	Total
8	8	8	0	16	0	0	40

- Especificació del model de regressió lineal: simple imúltiple
- Supòsits bàsics del model de regressió lineal
- Estimació per Mínims Quadrats Ordinaris
- Contrastació

Tema 3: Errors d'especificació

T	S	PS	L	E	PP	AA	Total

4	4	4	0	8	0	0	20
---	---	---	---	---	---	---	----

- Errors d'especificació
- Omissió de variables rellevants
- Inclusió de variables irrelevantes
- Forma funcional errònia

Tema 4: Extensió del model de regressió lineal

T	S	PS	L	E	PP	AA	Total
8	8	8	0	16	0	0	40

- Multicolinealitat
- Heterocedasticitat
- Autocorrelació
- Mínim Quadrats Generalitzats

Tema 5: Variables fictícies

T	S	PS	L	E	PP	AA	Total
4	4	4	0	8	0	0	20

- Model de Probabilitat Lineal
- Models LOGIT
- Modes PROBIT

Tema 6: Selecció de models

T	S	PS	L	E	PP	AA	Total
4	4	4	0	8	0	2	20

- Aplicació dels models econòmètrics
- Criteris de selecció de models econòmètrics

Metodologia

Dues hores de classes teòriques a la setmana més dues 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

Activitat	Hores	ECTS	Resultats d'aprenentatge
Tipus: Dirigides			
Pràctiques	30	1.2	2265:E02.10 , 2265:E09.19 , 2265:E07.20 , 2265:E03.08
Teoria	30	1.2	2265:E01.18 , 2265:E03.08 , 2265:E06.19 , 2265:E09.19 , 2265:E14.07 , 2265:E13.07 , 2265:E07.20
Tipus: Supervisades			
Preparació de problemes	30	1.2	2265:E01.18 , 2265:E02.10 , 2265:E03.08 , 2265:E13.07 , 2265:T05.00 , 2265:E14.07 , 2265:E07.20
Tipus: Autònomes			
Estudi	60	2.4	2265:E03.08 , 2265:E09.19 , 2265:E13.07 , 2265:E14.07 , 2265:E06.19

Avaluació

Avaluació continuada: Sí

Examen final: Obligatori per 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.

Activitats d'avaluació

Activitat	Pes	Hores	ECTS	Resultats d'aprenentatge
Examen Final	50%	0	0.0	2265:E03.08 , 2265:E06.19 , 2265:E07.20 , 2265:E13.07 , 2265:E09.19
Resolució d'exercicis	20%	0	0.0	2265:E02.10 , 2265:T05.00 , 2265:E14.07 , 2265:E03.08 , 2265:E06.19 , 2265:E09.19 , 2265:E07.20
Treball empíric	30%	0	0.0	2265:E01.18 , 2265:T05.00 , 2265:E14.07 , 2265:E02.10 , 2265:E03.08 , 2265:E09.19 , 2265:E07.20

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 Econométricos: Guía para la elaboración de modelos econométricos con Eviews". Ed. Pirámide
- Wooldridge, J.M. "Introducción a la Econometría: Un Enfoque Moderno" -Thomson Learning.