

Guia docent de l'assignatura "Models Econòmètrics"

2011/2012

Codi: 103214
Crèdits ECTS: 6

| Titulació | Pla | Tipus | Curs | Semestre |
|------------------------------|-------------------------------------|-------|------|----------|
| 2501919 Estadística Aplicada | 973 Graduat en Estadística Aplicada | OT | 0 | 0 |

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 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 econòmètrics.

Objectius i contextualització

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 i resultats d'aprenentatge

2272:E01 - Identificar i seleccionar les fonts d'obtenció de dades i depurar-les per tractar-les estadísticament.

2272:E01.29 - Identificar i seleccionar fonts d'informació específiques per a les anàlisis econòmètriques i depurar-ne les dades.

2272:E04 - Resumir i descobrir patrons de comportament en l'exploració de les dades.

2272:E04.43 - Explorar les dades econòmètriques per intuir patrons de comportament.

2272:E06 - Reconèixer la utilitat de la inferència estadística i de la recerca operativa i aplicar-les adequadament.

2272:E06.23 - Reconèixer la utilitat de la inferència aplicada a l'econometria.

2272:E07 - Analitzar les dades mitjançant l'aplicació de mètodes i tècniques estadístiques i treballar amb dades qualitatives i quantitatives.

2272:E07.28 - Aplicar tècniques estadístiques adequades a les dades econòmètriques.

2272:E09 - Identificar els models estadístics i de recerca operativa més adequats per a cada context i que permetin la presa de decisions.

2272:E09.26 - Identificar els models de regressió i multivariants més utilitzats en econometria.

2272:E10 - Interpretar resultats, extreure conclusions i elaborar informes tècnics.

2272:E10.21 - 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.

2272:E11 - 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.

2272:E11.33 - Utilitzar correctament el programari propi de les anàlisis econòmètriques.

2272: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.

2272:E13.11 - Identificar les eines estadístiques específiques de les anàlisis econòmètriques i utilitzar-les de manera apropiada per a extreure'n conclusions.

2272: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.

2272:E14.16 - Utilitzar eines d'Internet i bibliografia específica d'econometria.

2272:T06 - Desenvolupar l'interès pel coneixement i la interpretació de fenòmens susceptibles de quantificació.

2272:T06.00 - Desenvolupar l'interès pel coneixement i la interpretació de fenòmens susceptibles de quantificació.

2272:T12 - Expressar i aplicar rigorosament els coneixements adquirits en la resolució de problemes.

2272:T12.00 - Expressar i aplicar rigorosament els coneixements adquirits en la resolució de problemes.

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 econòmètrics

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 econòmètrics

Tema 4: Dades de panel

| T | S | PS | L | E | PP | AA | Total |
|---|---|----|---|----|----|----|-------|
| 0 | 6 | 3 | 3 | 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 polinòmials

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

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

| Activitat | Hores | ECTS | Resultats d'aprenentatge |
|----------------------------|-------|------|---|
| Tipus: Dirigides | | | |
| Problemas | 16 | 0.64 | 2272:E04.43 , 2272:T12.00 , 2272:T06.00 , 2272:E07.28 , 2272:E10.21 , 2272:E13.11 , 2272:E11.33 |
| Teoria | 32 | 1.28 | 2272:E06.23 , 2272:E09.26 , 2272:E10.21 , 2272:T06.00 , 2272:E13.11 |
| Tipus: Supervisades | | | |
| Altres activitats | 22 | 0.88 | 2272:E01.29 , 2272:E04.43 , 2272:E10.21 , 2272:E13.11 , 2272:T06.00 , 2272:T12.00 , 2272:E14.16 , 2272:E11.33 , 2272:E07.28 |
| Preparación de problemas | 16 | 0.64 | 2272:E01.29 , 2272:T06.00 , 2272:T12.00 , 2272:E14.16 , 2272:E04.43 , 2272:E07.28 , 2272:E11.33 , 2272:E10.21 |
| Tipus: Autònomes | | | |
| Estudi | 64 | 2.56 | 2272:E06.23 , 2272:E10.21 , 2272:E14.16 , 2272:T06.00 , 2272:E13.11 , 2272:E09.26 |

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 | 2272:E06.23 , 2272:E07.28 , 2272:E10.21 , 2272:E09.26 , 2272:T12.00 , 2272:T06.00 , 2272:E13.11 |
| Resolució d'exercicis | 20% | 0 | 0.0 | 2272:E04.43 , 2272:E07.28 , 2272:E10.21 , 2272:E13.11 , 2272:T06.00 , 2272:T12.00 , 2272:E14.16 , 2272:E11.33 |

| | | | | |
|--------------------|-----|---|-----|--|
| Treball empíric | 30% | 0 | 0.0 | 2272:E01.29 , 2272:E07.28 , 2272:E09.26 , 2272:E11.33 , 2272:E14.16 , 2272:T12.00 , 2272:T06.00 , 2272:E13.11 , 2272:E10.21 , 2272:E04.43 |
|--------------------|-----|---|-----|--|

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.