

Econometria

2013/2014

Codi: 100129

Crèdits: 6

Titulació	Tipus	Curs	Semestre
2500149 Matemàtiques	OT	4	0

Professor de contacte

Nom: Concepció Piñol Pérez

Correu electrònic: Conxita.Pinyol@uab.cat

Utilització d'idiomes

Llengua vehicular majoritària: català (cat)

Algun grup íntegre en anglès: No

Algun grup íntegre en català: Sí

Algun grup íntegre en espanyol: No

Prerequisits

Es recomana que l'alumne hagi cursat les assignatures d'àlgebra lineal, anàlisi matricial, teoria de la probabilitat i inferència estadística.

Objectius

L'objectiu fonamental del curs és dotar als alumnes de coneixements teòrics i pràctics de l'anàlisi i els models econòmics amb dades de panell, 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 econòmics aplicats, així com la capacitat per interpretar resultats econòmics.

Competències

- Matemàtiques
- Demostrar de forma activa una elevada preocupació per la qualitat en el moment d'argumentar o exposar les conclusions dels seus treballs
- Hauran desenvolupat aquelles habilitats d'aprenentatge necessàries per emprendre estudis posteriors amb un alt grau d'autonomia
- Utilitzar eficaçment bibliografia i recursos electrònics per obtenir informació

Resultats d'aprenentatge

1. Extracción de conclusiones y redacción de informes.
2. Identificación de la información relevante para resolver un problema.
3. Pensamiento y razonamiento cuantitativo.
4. Utilización correcta y racional del software.

Continguts

Tema 1: Introducció

- Què és l'econometria?

- Models econòmics i models econòmics

Tema 2: Revisió del model de regressió lineal

- Estimació, contrastació i predicció en el model de regressió lineal.

-Correcció d'errors i problemes.

Tema 3: Selecció del model

- Especificació i estimació de diferents models.

- Criteris de selecció de models econòmics

Tema 4: Models dinàmics

- Models dinàmics i desfases

- Anàlisi del multiplicador

- Model Koyck

- Retards polinomials

Tema 5: Models amb series temporals

- Series temporals

- Test de cointegració

- Arrels unitàries

Tema 6: Dades de panell

- 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			
Problemes	16	0,64	2, 3
Teoria	32	1,28	2, 3
Tipus: Supervisades			
Altres activitats	22	0,88	1, 2, 3, 4
Preparació de problemes	16	0,64	2, 3
Tipus: Autònomes			
Estudi	59	2,36	2, 3

Avaluació

Avaluació continuada : Sí

Examen Final: Obligatori per a tothom

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.

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.

Activitats d'avaluació

Títol	Pes	Hores	ECTS	Resultats d'aprenentatge
Examen Parcial	20%	2	0,08	2, 3, 4
Examen final	40%	3	0,12	2, 3, 4
Resolució d'exercicis	20%	0	0	3, 4
Treball empíric	20%	0	0	1, 2, 4

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