

Introducció a l'Econometria

2013/2014

Codi: 103177

Crèdits: 6

Titulació	Tipus	Curs	Semestre
2501919 Estadística Aplicada	OB	3	2

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 recomanable que l'alumne hagi 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

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 econòmics aplicats, així com la capacitat per interpretar resultats econòmics generals.

Competències

Estadística Aplicada

- Analitzar les dades mitjançant l'aplicació de mètodes i tècniques estadístiques i treballar amb dades qualitatives i quantitatives.
- Coordinar i treballar en equip amb grups potencialment multidisciplinaris.
- Dissenyar enquestes i explotar bases de dades.
- 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.
- Reconèixer la utilitat de la inferència estadística i de la recerca operativa i aplicar-les adequadament.
- Seleccionar el tipus de mostreig apropiat per a l'estudi.
- Utilitzar bibliografia o eines d'Internet específiques de l'estadística i d'altres ciències afins, tant en llengua anglesa com en la llengua pròpia.

Resultats d'aprenentatge

1. Analitzar dades d'estadística oficial i econometria treballant amb dades qualitatives i quantitatives.
2. Coordinar i treballar en equip amb grups potencialment multidisciplinaris.
3. Gestionar i explotar bases de dades disponibles en els instituts d'estadística.
4. Identificar els models estadístics més importants en econometria i aplicar-los.

5. 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.
6. Identificar la utilitat dels coneixements estadístics en bioinformàtica, ciències de la salut, econometria, estadística industrial i estadística oficial.
7. Identificar les fonts d'informació més importants en estadística oficial i econometria.
8. Reconèixer la utilitat de la inferència estadística per a l'estadística oficial i l'econometria.
9. Seleccionar el tipus de mostreig apropiat en el context de l'estadística oficial i l'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
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 i múltiple
- Supòsits bàsics del model de regressió lineal
- Estimació per Mínims Quadrats Ordinaris
- Contrastació
- Predicció
- Variables fictícies

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: Models amb variable dependent discreta

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

- Model de Probabilitat Lineal
- Models LOGIT
- Models 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 econòmics
- Criteris de selecció de models econòmics

Metodologia

Dues hores de classes teòriques a la setmana més dues de pràctiques (amb software econòmic) 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			
Pràctiques	30	1,2	1, 3, 4, 9
Teoria	30	1,2	1, 4, 5, 6, 7, 8, 9
Tipus: Supervisades			
Preparació de problemes	30	1,2	1, 2, 3, 5, 6, 7, 9
Tipus: Autònomes			
Estudi	60	2,4	4, 5, 6, 8, 9

Avaluació

Avaluació continuada: Sí

Examen final: Obligatori per 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.

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, 4, 6, 8, 9
Examen Parcial	20%	0	0	1, 4, 5, 8, 9
Resolució d'exercicis	20%	0	0	1, 2, 3, 4, 5, 8, 9
Treball empíric	20%	0	0	1, 2, 3, 4, 5, 7, 9

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 econométricos con Eviews". Ed. Pirámide
- Wooldridge, J.M. "Introducción a la Econometría: Un Enfoque Moderno" -Thomson Learning.