

Models Economètrics**2013/2014**

Codi: 103214

Crèdits: 6

Titulació	Tipus	Curs	Semestre
2501919 Estadística Aplicada	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 recomanable que l'alumne hagi 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 economètrics.

Objectius

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

Competències

Estadística Aplicada

- Analitzar les dades mitjançant l'aplicació de mètodes i tècniques estadístiques i treballar amb dades qualitatives i quantitatives.
- Desenvolupar l'interès pel coneixement i la interpretació de fenòmens susceptibles de quantificació.
- 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.
- Interpretar resultats, extreure conclusions i elaborar informes tècnics.
- Reconèixer la utilitat de la inferència estadística i de la recerca operativa i aplicar-les adequadament.
- Resumir i descobrir patrons de comportament en l'exploració de les dades.
- Utilitzar bibliografia o eines d'Internet específiques de l'estadística i d'altres ciències afins, tant en llengua anglesa com en la llengua pròpia.
- 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.

Resultats d'aprenentatge

1. Aplicar tècniques estadístiques adequades a les dades economètriques.
2. 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 economètriques i extreure'n conclusions.
3. Desenvolupar l'interès pel coneixement i la interpretació de fenòmens susceptibles de quantificació.

4. Explorar les dades economètriques per intuir patrons de comportament.
5. Identificar els models de regressió i multivariants més utilitzats en econometria.
6. Identificar i seleccionar fonts d'informació específiques per a les anàlisis economètriques i depurar-ne les dades.
7. Reconèixer la utilitat de la inferència aplicada a l'econometria.
8. Utilitzar correctament el programari propi de les anàlisis economètriques.
9. Utilitzar eines d'Internet i bibliografia específica d'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	1	1	0	4	0	0	8

- Què és l'econometria?

- Models econòmics i models economètrics

Tema 2: Revisió del model de regressió lineal

T	S	PS	L	E	PP	AA	Total
8	4	4	0	16	0	8	40

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

-Correcció d'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 economètrics

Tema 4: 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 5: 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

Tema 6: Dades de panell

T	S	PS	L	E	PP	AA	Total
0	6	3	3	12	0	6	30

- 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			
Problemas	16	0,64	1, 2, 3, 4, 8
Teoría	32	1,28	2, 3, 5, 7

Tipus: Supervisades			
Altres activitats	22	0,88	1, 2, 3, 4, 6, 8, 9
Preparació de problemes	16	0,64	1, 2, 3, 4, 6, 8, 9
Tipus: Autònomes			
Estudi	64	2,56	2, 3, 5, 7, 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 Parcial	20%	0	0	
Examen final	40%	0	0	1, 2, 3, 5, 7
Resolució d'exercicis	20%	0	0	1, 2, 3, 4, 8, 9
Treball empíric	20%	0	0	1, 2, 3, 4, 5, 6, 8, 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 económicos con Eviews". Ed. Pirámide
- Wooldridge, J.M. "Introducción a la Econometría: Un Enfoque Moderno" -Thomson Learning.