

Econometria**2015/2016**

Codi: 102105

Crèdits: 6

Titulació	Tipus	Curs	Semestre
2501231 Comptabilitat i Finances	OB	3	1

Professor de contacte

Nom: Maria Teresa Cabeza Gutes

Correu electrònic: Maite.Cabeza@uab.cat

Utilització de llengües

Llengua vehicular majoritària: català (cat)

Prerequisites

És altament recomanable que l'estudiant hagi superat les Matemàtiques I, II i l'Estadística I i II. Tenir assolits els continguts d'aquestes assignatures és imprescindible per poder seguir amb èxit l'*Econometria*.

Objectius

L'assignatura *Econometria* presenta les eines bàsiques per l'anàlisi empírica de relacions entre variables econòmiques. El curs comença amb el model de regressió simple, presentat a l'assignatura d'Estadística II, i s'estén al model de regressió múltiple, considerant tant variables explicatives quantitatives com qualitatives.

L'objectiu és que l'estudiant aprengui a extreure informació de dades econòmiques utilitzant el model de regressió lineal, sabent valorar amb rigor els seus avantatges i limitacions. Es posarà especial èmfasi en què l'estudiant assimili, de la forma més intuïtiva possible, els aspectes teòrics de l'anàlisi economètrica. Al llarg del curs es presentaran nombroses aplicacions, treballant amb dades reals i software economètric, amb l'objectiu que l'estudiant valori els aspectes pràctics de les eines presentades.

Competències

- Aplicar la metodologia economètrica adequada per donar resposta als problemes que apareixen en l'estudi empíric d'algunes dades econòmiques.
- Capacitat de seguir estudiant en el futur de manera autònoma, profunditzant en els coneixements adquirits o iniciant-se en noves àrees de coneixement.
- Tenir capacitat de comunicació oral i escrita en català, castellà i anglès, per poder sintetitzar i presentar oralment i per escrit el treball dut a terme.

Resultats d'aprenentatge

1. Analitzar el comportament de sèries temporals econòmiques i fer prediccions.
2. Capacitat de seguir estudiant en el futur de manera autònoma, profunditzant en els coneixements adquirits o iniciant-se en noves àrees de coneixement.
3. Especificar models, mètodes d'estimació i inferència.
4. Identificar i aplicar la metodologia economètrica adequada per donar resposta als problemes que apareixen en l'estudi empíric d'algunes dades econòmiques.
5. Preparar les dades obtingudes de les fonts per fer-ne posteriorment una anàlisi quantitativa.
6. Tenir capacitat de comunicació oral i escrita en català, castellà i anglès, per poder sintetitzar i presentar oralment i per escrit el treball dut a terme.
7. Utilitzar informació econòmica procedent de diverses fonts: bases de dades, Internet, etc.
8. Utilitzar programes informàtics per fer l'anàlisi quantitativa de les dades.

Continguts

Tema 1: Introducció a l'anàlisi economètrica

- Què és l'econometria? Objectius.
- Naturalesa i estructura de les dades econòmiques.
- Causalitat versus correlació.

Tema 2: El model de regressió simple

- El model de regressió simple. La recta de regressió.
- Estimació per mínims quadrats ordinaris. La recta ajustada.
- Bondat de l'ajust. El coeficient de determinació.
- Propietats numèriques de l'estimador.
- Distribució de l'estimador.
- Propietats estadístiques de l'estimador.
- Aplicacions.

Tema 3: El model de regressió lineal múltiple: estimació

- El model de regressió lineal amb múltiple.
- Estimació per mínims quadrats ordinaris. El model ajustat.
- El coeficient de determinació i el coeficient de determinació ajustat.
- Model de regressió i forma funcional.
- Distribució i propietats de l'estimador.
- Els components de la variància de l'estimador MQO.
- Estimació sota la presència de col·linealitat.
- Aplicacions.

Tema 4: El model de regressió múltiple: inferència

- Contrast d'hipòtesis amb l'estadístic t. Test de significança individual.
- Intervals de confiança d'un paràmetre.
- Contrast d'hipòtesis amb l'estadístic F.
- L'estadístic F via estimació restringida. Test de significança global.
- L'ús de variables fictícies. Test de canvi estructural.
- Inferència sota la presència de col·linealitat.
- Aplicacions.

Metodologia

Les activitats que ha de seguir l'estudiant per poder assimilar correctament els continguts d'aquesta assignatura són les següents:

1. Classes teòriques

En les anomenades classes teòriques, el professor presentarà els principals conceptes i mètodes. Aquesta presentació anirà sovint acompanyada d'exemples per facilitar l'aprenentatge del material exposat.

2. Classes a l'aula d'informàtica

Per una millor assimilació dels conceptes presentats es realitzaran classes a les aules d'informàtica. El software economètric que donarà suport a aquestes classes serà principalment Gretl, software de lliure accés ja utilitzat en l'assignatura d'Estadística II. L'estudiant es familiaritzarà en nous aspectes d'aquest software, com és l'ús d'opcions addicionals dels seus menús o la utilització de guions d'instruccions.

3. Classes de resolució d'exercicis

Cada tema tindrà associat una llista de problemes que els estudiants hauran de treballar pel seu compte, individualment o en grups. Aquesta activitat és crucial perquè l'estudiant assimili els aspectes teòrics i valori l'aplicació de les eines presentades. El professor seleccionarà alguns d'aquests exercicis per ser discutits a classe. Aquesta activitat té com a objectiu comentar i resoldre dubtes que hagin pogut sorgir en alguns dels exercicis i aplicacions inclosos. El professor podrà utilitzar algunes de les classes de resolució d'exercicis com a activitat d'avaluació.

4. Tutories presencials

L'alumne disposarà d'unes hores on el professor de l'assignatura podrà resoldre dubtes puntuals. L'horari específic d'aquestes tutories es podrà consultar en el Campus Virtual o la web del mateix professor.

5. Estudi

Les activitats anteriors ocupen només un terç del temps que l'estudiant ha de dedicar a aquesta assignatura. La resta està ocupada pel treball autònom del mateix estudiant (estudi, consulta dels manuals de referència, resolució de problemes i aplicacions o pràctiques amb el software indicat). El treball de l'estudiant és un element crucial per l'assimilació de la matèria.

Important :

- Per poder superar amb èxit el curs l'estudiant ha d'assistir al 100% de les classes.
- Pel bon funcionament de la classe: No es pot arribar tard, ni entrar ni sortir de l'aula durant la classe.

Activitats formatives

Títol	Hores	ECTS	Resultats d'aprenentatge
Tipus: Dirigides			
Classes de resolució d'exercicis i aplicacions	15	0,6	1, 3, 4, 5, 7, 8
Classes teòriques	30	1,2	1, 3, 4, 8
Tipus: Supervisades			
classes a l'aula d'informàtica	7	0,28	1, 4, 5, 7, 8
Tipus: Autònomes			
Estudi i resolució d'exercicis i aplicacions	90	3,6	1, 3, 4, 5, 6, 7, 8

Avaluació

L'avaluació de l'alumne es realitzarà en funció dels resultats de les següents activitats:

1. Un examen parcial

En aquesta prova escrita s'avaluarà a l'estudiant sobre el contingut del Tema 1 i 2. Durant la prova no es permetrà consultar cap tipus de material. La nota vindrà donada sobre 10. Aquesta prova representa el 20% de la nota del curs.

2. Un examen final

L'examen final té com a objectiu valorar si l'estudiant ha assolit els principals continguts de l'assignatura. S'avaluarà a l'estudiant sobre el contingut de tot el temari (Tema 1, 2, 3 i 4). Durant l'examen no es permetrà consultar cap tipus de material. La nota vindrà donada sobre 10. Aquesta prova representa el 70% de la nota del curs.

4. Exercicis

Al llarg del curs els estudiants lliuraran de forma ocasional una selecció d'exercicis. El professor pot demanar que la resolució d'exercicis per activitat avaluativa sigui feta en horari de classe. La nota vindrà donada sobre 10. La nota dels exercicis representa el 10% de la nota del curs.

Criteris d'avaluació:

a. Un cop publicades les qualificacions de l'examen final, es publicarà també la nota del curs. La nota del curs ve donada per:

$$\text{NOTA DEL CURS} = 0,10 \cdot \text{EXERCICIS} + 0,20 \cdot \text{PARCIAL} + 0,70 \cdot \text{FINAL}$$

b. L'assignatura es considera superada si la nota del curs és igual o superior a 5.

c. Un estudiant que no es presenta a cap prova avaluatoria es considera no avaluable.

d. Tots els estudiants han de respectar les dates de realització de qualsevol activitat avaluativa. En cap cas es realitzaran proves fora de les dates marcades.

Calendari d'avaluació

Les dates dels exàmens (parcial i final) estan marcades en el calendari d'exàmens de la facultat.

Publicació i revisió de qualificacions

Després de cada activitat d'avaluació es publicaran les qualificacions al Campus Virtual o a la web del propi professor. De la mateixa manera, s'informarà del procediment, lloc, data i hora de la revisió d'exàmens d'acord amb la normativa vigent.

Re-avaluació

Per aquells estudiants amb una nota del curs igual o superior a 4 però inferior a 5 hi haurà una re-avaluació. Aquesta re-avaluació estarà programada en el calendari d'exàmens de la Facultat. La nota de la revaluació serà qualitativa i només tindrà dues possibles opcions: APTE o NO APTE. Si l'estudiant obté una nota d'APTE es considera que ha superat l'assignatura amb una nota numèrica màxima igual a 5. Si l'alumne obté una qualificació de NO APTE, no supera l'assignatura i la nota final serà igual a la nota obtinguda abans de la revaluació.

Codi d'honor

Sense perjudici d'altres mesures disciplinàries que s'estimin oportunes, i d'acord amb la normativa acadèmica vigent, es qualificaran amb un zero les irregularitats comeses per l'estudiant que puguin conduir a una variació de la qualificació d'un acte d'avaluació. Per tant, copiar o deixar copiar una pràctica o qualsevol altra activitat d'avaluació implicarà suspendre-la amb un zero, i si és necessari superar-la per aprovar, tota l'assignatura quedarà suspesa. No seran recuperables les activitats d'avaluació qualificades d'aquesta forma i per aquest procediment, i per tant l'assignatura serà suspesa directament sense oportunitat de recuperar-la en el mateix curs acadèmic.

Activitats d'avaluació

Títol	Pes	Hores	ECTS	Resultats d'aprenentatge
Exàmens (Parcial, Final)	90	4	0,16	1, 2, 3, 4, 6, 8
Exercicis	10	4	0,16	1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8

Bibliografia

Llibres de text:

-Wooldridge, J. M., *Introductory Econometrics: A Modern Approach*. South-Western Cengage learning. 5ed. 2013. Darrera versió en castellà: *Introducción a la Econometría*, Cengage Learning editores, 4a ed. No hi ha versió en català.

-Uriel Jiménez, E., *Introducción a la Econometría*. Llibre electrònic. Universidad de Valencia. No hi ha versió en català.