



Universitat de Lleida

GUIA DOCENT
ECONOMETRIA

Any acadèmic 2013-14

Informació general de l'assignatura

Denominació	ECONOMETRIA
Codi	101329
Semestre d'impartició	2n Q Avaluació Continuada
Caràcter	Obligatòria
Nombre de crèdits ECTS	6
Grups	2 GG i 5 GM
Crèdits teòrics	0
Crèdits pràctics	0
Departament/s	ECONOMIA APLICADA
Distribució càrrega docent entre la classe presencial i el treball autònom de l'estudiant	40%) 60h presencials i (60%) 90h treball autònom
Informació important sobre tractament de dades	Consulteu aquest enllaç per a més informació.
Idioma/es d'impartició	Català
Horari de tutoria/lloc	Dimarts de 12 a 14 h i Dijous de 10 a 12 h al Despatx 0.23

Informació complementària de l'assignatura

L'economia és una ciència empírica on la confirmació de qualsevol proposició es realitza per la via de la contrastació, conjugant-se teoria econòmica i coneixement empíric, de manera que la combinació de la teoria amb l'experiència permet la formulació de models econòmics. Així l'Econometria és una disciplina orientada a la contrastació empírica de les teories que tracten dels fenòmens econòmics i empresarials i, la descripció i predicció de la realitat econòmica utilitzant mitjans estadístics.

El tractament de dades i l'estadística en general, així com els mètodes econòmics en particular, són un instrument imprescindible en molts camps d'actuació empresarial: Direcció comercial, direcció estratègica, previsions i qualsevol matèria en la que es vulgui analitzar la informació que proporcionen les dades i es vulguin establir relacions entre diferents variables.

L'objectiu fonamental que es vol aconseguir amb aquesta assignatura és saber donar sentit als resultats que s'obtenen de la utilització d'un model econòmic.

Objectius acadèmics de l'assignatura

- Utilitzar la terminologia econòmica adequada (CEU1)
- Us dels recursos TIC necessaris en el seguiment de l'assignatura (CEU3)
- Reconèixer les dades i les tècniques econòmiques més adequades (CES4) i (CB2)
- Especificar correctament un model econòmic (CES4)
- Estimar un model econòmic (CES4)
- Validar un model econòmic estimat (CES4)
- Fixar adequadament l'objectiu objecte d'estudi (CES5)
- Interpretar adequadament la informació subministrada per un model econòmic (CES5)
- Aplicar els resultats d'un model econòmic en la presa de decisions (CES5)

Competències

Competències estratègiques de la Universitat de Lleida

- Domini de les Tecnologies de la Informació i la Comunicació.
- Ús dels recursos TIC necessaris en el seguiment de l'assignatura.
- Domini d'una llengua estrangera
- Correcció en l'expressió oral i escrita
- Utilitzar la terminologia econòmica adequada.

Competències específiques de la titulació

- Identificar i interpretar els factors econòmics, ambientals, polítics, sociològics i tecnològics en els àmbits local, nacional i internacional i la seva repercussió sobre les organitzacions.
 - Interpretar adequadament la informació subministrada per un model econòmic.
 - Aplicar els resultats d'un model econòmic en la presa de decisions.
 - Fixar adequadament l'objectiu d'estudi.
- Ocupar les funcions relacionades amb les diferents àrees funcionals d'una empresa i institucions.
- Aplicar tècniques instrumentals en l'anàlisi i solució de problemes empresarials i en la presa de decisions.
 - Reconèixer les dades i les tècniques econòmiques més adequades.
 - Especificar correctament un model econòmic.
 - Estimar un model econòmic.
 - Validar un model econòmic.

- Crear i dirigir una empresa atenent i responent als canvis de l'entorn en el qual opera.
- Elaborar, interpretar i auditar la informació economicofinancera d'entitats i particulars i prestar-los assessorament.
- Intervenir en operacions pròpies d'entitats i mercats financers.

Competències transversals de la titulació

- Ser capaç de treballar i d'aprendre de forma autònoma i simultàniament interactuar adequadament amb els altres, cooperant i col·laborant.
- Capacitat de crítica i autocrítica.
- Treball en equip i lideratge.
- Actuar sobre la base del rigor, el compromís personal i l'orientació a la qualitat.
- Capacitat d'organitzar i planificar.
- Reconèixer les dades i les tècniques econòmiques més adequades.
- Capacitat d'anàlisi i de síntesi.

Continguts fonamentals de l'assignatura

I. Model de regressió bàsic

- I.1. Introducció
 - I.1.1. Objectius de l'econometria
 - I.1.2. Modelització. Fases de la investigació economètrica.
 - I.1.3. Metodologia economètrica
- I.2. Model de regressió lineal múltiple bàsic.
 - I.2.1. Model de regressió lineal simple.
 - I.2.2. Formulació i hipòtesis del model de RLM.
 - I.2.3. Estimadors mínims quadrats ordinaris.
 - I.2.4. Estimació per intervals i contrastos d'hipòtesis en el model.
 - I.2.5. Predicció
 - I.2.6. Estimacions restringides.
 - I.2.7. Anàlisi dels residuals.
 - I.2.8. Permanència estructural.

II. Ampliacions al model de regressió

- II.1. Errors d'especificació i multicolinealitat.
 - II.1.1. Validació del model.
 - II.1.2. Errors d'especificació en les variables.
 - II.1.3. Definició i conseqüències de lamulticolinealitat.
 - II.1.4. Detecció de la multicolinealitat.
 - II.1.5. Possibles solucions a la multicolinealitat elevada.
 - II.1.6. Observacions atípiques i influents.
- II.2. Pertorbacions no esfèriques.
 - II.2.1. Definició i conseqüències.
 - II.2.2. Mínims quadrats generalitzats.
 - II.2.3. Heteroscedasticitat. Causes, detecció i estimació.
 - II.2.4. Autocorrelació. Causes, detecció i estimació.
- II.3. Variables qualitatives.
 - II.3.1. Variables exògenes qualitatives. Variables fictícies.
 - I.3.2. Variables fictícies i models temporals.

I.3.3. Variable endògena qualitativa. Models i estimació.

Eixos metodològics de l'assignatura

Dates (Setmanes)	Descripció:	Activitat Presencial	HTP (2) (Hores)	Activitat treball autònom	HTNP (3) (Hores)
1	GG: Presentació assignatura i Model de regressió bàsic GM: Pràctica 1	Lliçó magistral i problemes Resolució activitats	2h. 1h. 30 m	Estudi teoria i realització exercicis	4,7h.
2	GG: Model de regressió lineal múltiple GM: Pràctica 1	Lliçó magistral i problemes Resolució activitats	2h. 1h. 30 m	Estudi teoria i realització exercicis	4, h.
3	GG: Model de regressió lineal múltiple GM: Pràctica 1	Lliçó magistral i problemes Resolució activitats	2h. 1h. 30 m	Estudi teoria i realització exercicis	4,7h.
4	GG: Model de regressió lineal múltiple GM: Pràctica 1	Lliçó magistral i problemes Resolució activitats	2h. 1h. 30 m	Estudi teoria i realització exercicis	4,7h.
5	GG: Model de regressió lineal múltiple GM: Treball	Lliçó magistral i problemes Elaboració treball	2h. 1h. 30 m	Estudi teoria i realització exercicis	4,7h.
6	GG: Errors d'especificació i multicolinealitat GM: Pràctica 2	Lliçó magistral i problemes Resolució activitats	2h. 1h. 30 m	Estudi teoria i realització exercicis	4, h.
7	GG: Errors d'especificació i multicolinealitat GM: Pràctica 2	Lliçó magistral i problemes Resolució activitats	2h. 1h. 30 m	Estudi teoria i realització exercicis	4,7h.
8	GG: Activitat d'avaluació 1	Prova escrita	2h.		7,4h.
9	GG: Pertorbacions no esfèriques GM: Pràctica 3	Lliçó magistral i problemes Resolució activitats	2h. 1h. 30 m	Estudi teoria i realització exercicis	4,7h.
10	GG: Pertorbacions no esfèriques GM: Pràctica 3	Lliçó magistral i problemes Resolució activitats	2h. 1h. 30 m	Estudi teoria i realització exercicis	4,7h.
11	GG: Pertorbacions no esfèriques GM: Treball	Lliçó magistral i problemes Elaboració treball	2h. 1h. 30 m	Estudi teoria i realització exercicis	4,7h.
12	GG: Pertorbacions no esfèriques GM: Treball	Lliçó magistral i problemes Elaboració treball	2h. 1h. 30 m	Estudi teoria i realització exercicis	4,7h.
13	GG: Pertorbacions no esfèriques GM: Pràctica 3	Lliçó magistral i problemes Resolució activitats	2h. 1h. 30 m	Estudi teoria i realització exercicis	4,7h.
14	GG: Variables qualitatives GM: Pràctica 4	Lliçó magistral i problemes Resolució activitats	2h. 1h. 30 m	Estudi teoria i realització exercicis	4,7h.

15	GG: Variables qualitatives GM: Pràctica 4	Lliçó magistral i problemes Resolució activitats	2h. 1h. 30 m	Estudi teoria i realització exercicis	4,7h.
16	GG: Activitat d'avaluació 2	Prova escrita	2h.		7,4h.

Pla de desenvolupament de l'assignatura

Objectius	Activitats d'Avaluació Criteris	%	Dates	O/V (1)	I/G (2)	Observacions
Avaluar els coneixements adquirits fins la data	Activitat d'avaluació 1	40%	Setmana 8 GG	O	I	Prova escrita
Avaluar els coneixements adquirits de tot el curs	Activitat d'avaluació 2	40%	Setmana 16 GG	O	I	Prova escrita
Aplicació dels continguts teòrics	Treball	20%	Setmana 15 GM	O	I	Presentació oral i escrita

Sistema d'avaluació

Les dues activitats d'avaluació i el treball són individuals i obligatòries per obtenir la qualificació final.

L'alumne que no obtingui qualificació en l'activitat d'avaluació 2, obtindrà com a nota final d'aquesta assignatura la qualificació de NO PRESENTAT.

Cada activitat es valorarà amb una nota entre 0 i 10.

És necessari haver realitzat totes les proves per poder accedir a la prova de RECUPERACIÓ.

Bibliografia i recursos d'informació

ALEGRE, J; ARCARONS, J.; BOLANCE, C. i DÍAZ, L. (1995). Ejercicios y problemas de Econometría. Ed. AC
 AZNAR, A.; GARCIA, J. (1981). Problemas de Econometría. Ed. Pirámide
 GRANDE, J.; ABASCAL, E. (1989). Métodos multivariantes para la investigación comercial. Ed. Ariel
 JOHNSTON, J. (1987). Métodos Económicos. Ed. Vicens Vives
 KMENTA, J. (1985). Elementos de Econometría. Ed. Vicens Vives
 MADDALA, G.S. (1985). Econometría. Ed. McGraw-Hill
 MATILLA, M; PÉREZ, P.; SANZ, B. (2013). Econometría y Predicción. Ed. Mc Graw Hill
 PARRA, I. (2003). Problemas de Inferencia Estadística. Ed. AC
 PULIDO, A. (1983). Modelos Económicos. Ed. Pirámide
 STOCK, J. ; WATSON, M (2012). Introducción a la Econometria. Ed. Pearson
 UOC. Introducció a l'econometria. Ed. Universitat Oberta de Catalunya
 URIEL, E. et al. (1990). Econometría: El modelo lineal. Ed. AC

Webgraria bàsica

<http://www.idescat.cat/>
<http://www.ine.es/>
<http://www.bde.es/webbde/es/estadis/infoest/bolest.html>
<http://serviciosweb.meh.es/apps/dgpe/default.aspx>
http://europa.eu/documentation/statistics-polls/index_es.htm
<http://www.sepe.es/contenido/estadisticas/>

