



Universitat de Lleida

GUÍA DOCENTE
ECONOMETRÍA

Año académico 2013-14

Información general de la asignatura

Denominación	ECONOMETRÍA
Código	101329
Semestre de impartición	2n Q Evaluación Continuada
Carácter	Obligatoria
Número de créditos ECTS	6
Grupos	2 GG y 5 GM
Créditos teóricos	0
Créditos prácticos	0
Departamento/s	ECONOMIA APLICADA
Distribución carga docente entre la clase presencial y el trabajo autónomo del estudiante	40%) 60h presenciales i (60%) 90h trabajo autónomo
Información importante sobre tratamiento de datos	Consulte este enlace para obtener más información.
Idioma/es de impartición	Catalán
Horario de tutoría/lugar	Martes de 12 a 14 h y jueves de 10 a 12 h al Despacho 0.23

M. Àngels Cabasés Piqué

Información complementaria de la asignatura

Asignatura/materia en el conjunto del plan de estudios

La economía es una ciencia empírica donde la confirmación de cualquier proposición se realiza por la vía de la contrastación, conjugándose teoría económica y conocimiento empírico, de forma que la combinación de la teoría con la experiencia permite la formulación de modelos económicos. Así la Econometría es una disciplina orientada a la contrastación empírica de las teorías que tratan de los fenómenos económicos y empresariales, y la descripción y predicción de la realidad económica utilizando medianos estadísticos. El tratamiento de datos y la estadística en general, así como los métodos econométricos en particular, son un instrumento imprescindible en muchos campos de actuación empresarial: Dirección comercial, Dirección Estratégica, Previsiones y cualquier materia en la que se quiera analizar la información que proporcionan los datos y se quieran establecer relaciones entre diferentes variables. El objetivo fundamental que se quiere conseguir con esta asignatura es saber dar sentido a los resultados que se obtienen en todas las etapas de la utilización de un modelo econométrico. 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 economètric.

Objetivos académicos de la asignatura

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

Competencias

Competencias estratégicas de la Universidad de Lleida

- Dominio de las Tecnologías de la Información y la Comunicación.

Objetivos

- Uso de los recursos TIC necesarios en el seguimiento de la asignatura.
- Corrección en la expresión oral y escrita

Objetivos

- Utilizar la terminología economètrica adecuada.
- Dominio de una lengua extranjera

Competencias específicas de la titulación

- Desempeñar las funciones relacionadas con las distintas áreas funcionales de una empresa e instituciones.
- Aplicar técnicas instrumentales en el análisis y solución de problemas empresariales y en la toma de decisiones.

Objetivos

- Reconocer los datos y las técnicas economètriques más adecuadas.
- Especificar correctamente un modelo economètric.
- Estimar un modelo econométrico.
- Validar un modelo econométrico.
- Intervenir en operaciones propias de entidades y mercados financieros.
- Crear y dirigir una empresa atendiendo y respondiendo a los cambios del entorno en el que opera.
- Identificar e interpretar los factores económicos, ambientales, políticos, sociológicos y tecnológicos en los ámbitos local, nacional e internacional y su repercusión sobre las organizaciones.

Objetivos

- Interpretar adecuadamente la información suministrada por un modelo econométrico.
- Aplicar los resultados de un modelo econométrico en la toma de decisiones.
- Fijar adecuadamente el objetivo de estudio.
- Elaborar, interpretar y auditar la información económico-financiera de entidades y particulares, y prestar asesoramiento sobre los mismos.

Competencias transversales de la titulación

- Actuar en base al rigor, al compromiso personal y con orientación a la calidad.
- Capacidad de organizar y planificar.

Objetivos

- Reconocer los datos y las técnicas economètriques más adecuadas.

- Ser capaz de trabajar y de aprender de forma autónoma y simultáneamente interactuar adecuadamente con los demás, cooperando y colaborando.
- Capacidad de crítica y autocrítica.
- Trabajo en equipo y liderazgo.
- Capacidad de análisis y de síntesis.

Contenidos fundamentales de la asignatura

A. Modelo de regresión básico

1. Introducción

1.1 Objetivos de la econometría

1.2 Modelización. Fases de la investigación econométrica.

1.3 Metodología econométrica

2. Modelo de regresión lineal múltiple básico.

2.1 Modelo de regresión lineal simple.

2.2 Formulación de hipótesis del modelo de RLM.

2.3 Estimadores mínimos cuadrados ordinarios.

2.4 Estimación por intervalos y contrastes de hipótesis en el modelo.

2.5 Predicción

2.6 Estimaciones restringidas.

2.7 Análisis de los residuales.

2.8 Permanencia estructural.

B. Ampliaciones al modelo de regresión.

1. Errores de especificación y multicolinealidad.

1.1 Validación del modelo.

1.2 Errores de especificación en las variables.

1.3 Definición y consecuencias de la multicolinealidad.

1.4 Detección de la multicolinealidad.

1.5 Posibles soluciones a la multicolinealidad elevada.

1.6 Observaciones atípicas e influyentes.

2. Perturbaciones no esféricas.

2.1 Definición y consecuencias.

2.2 Mínimoscuadrados generalizados.

2.3 Heteroscedasticidad. Causas, detección y estimación.

2.4 Autocorrelación. Causas, detección y estimación.

3. Variables cualitativas.

3.1 Variables exógenas cualitativas. Variables ficticias.

3.2 Variables ficticias y modelos temporales.

3.3 Variable endógena cualitativa. Modelos y estimación.

Ejes metodológicos de la asignatura

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.

Plan de desarrollo de la asignatura

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 de evaluación

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.

Bibliografía y recursos de información

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 Econométricos. 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 básica

<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/>

