



Any acadèmic	2012-13
Assignatura	21205 - Econometria
Grup	Grup 68, 1S, Menorca, GADE
Guia docent	C
Idioma	Català

Identificació de l'assignatura

Assignatura	21205 - Econometria
Crèdits	2.4 presencials (60 hores) 3.6 no presencials (90 hores) 6 totals (150 hores).
Grup	Grup 68, 1S, Menorca, GADE(Campus Extens)
Període d'impartició	Primer semestre
Idioma d'impartició	Català

Professors

Professors	Horari d'atenció alumnat					
	Hora d'inici	Hora de fi	Dia	Data d'inici	Data de fi	Despatx
Andreu Sansó Rosselló andreu.sanso@uib.es	11:00h	12:00h	Dimarts	16/10/2012	25/02/2013	DB227 - Cita prèvia per e-amil

Titulacions on s'imparteix l'assignatura

Titulació	Caràcter	Curs	Estudis
Grau d'Administració d'Empreses	Obligatòria	Segon curs	Grau
Doble titulació: Grau d'Administració d'Empreses i Grau de Dret	Obligatòria	Tercer curs	Grau

Contextualització

Els continguts de l'assignatura " Econometria " detallen i desenvolupen alguns aspectes ja estudiats en l'assignatura "Anàlisi de Dades Econòmiques " , en particular els principis d'inferència estadística , els conceptes d'estimador i interval de confiança , bé com el procediment de contrastació d'hipòtesis . Per a un millor seguiment dels continguts de " Econometria " s'aconsella als estudiants que revisin aquestes matèries de " Anàlisi de Dades Econòmiques " només començar el segon curs .

L'objectiu principal de l'assignatura " Econometria " és l'estudi detallat d'algunes tècniques econòmiques comunament utilitzades en la recerca aplicada en l'àmbit de l'economia i de l'empresa . La primera part comença amb l'estudi del model de regressió lineal simple i la seva generalització a la regressió múltiple , considerant els mètodes de contrast d'hipòtesis rellevants . La segona part se centra en el problema de l'especificació del model de regressió , en particular els errors d'especificació i problemes amb la mostra , bé com la incorporació de variables explicatives qualitatives . Finalment , la tercera part estudia l'incompliment d'hipòtesis bàsiques sobre el terme d'error de la regressió , el que origina els problemes de heteroscedasticitat i autocorrelació .

Requisits





Any acadèmic	2012-13
Assignatura	21205 - Econometria
Grup	Grup 68, 1S, Menorca, GADE
Guia docent	C
Idioma	Català

Un bon coneixement dels continguts de l'assignatura "Anàlisi de Dades Econòmiques " facilitarà la comprensió dels continguts de l'assignatura " Econometria " .

Competències

L'objectiu fonamental d'aquesta assignatura és el coneixement per part dels alumnes d'algunes tècniques economètriques comunament utilitzades en la recerca aplicada en l'àmbit de l'economia i de l'empresa . Es pretén proporcionar una formació bàsica en el domini de les tècniques economètriques com a instruments d'anàlisi de dades econòmiques i empresarials , utilitzant quadres teòrics d'altres assignatures d'economia i d'empresa , i sent capaç d'interpretar i explicar els resultats obtinguts a la llum d'aquestes teories . Els mètodes i tècniques explicats en aquesta assignatura seran transposables per dades econòmiques i empresarials que els alumnes puguin trobar en el seu futur professional .

Específiques

1. CE2.1.7 A partir de dades d'interès economicoempresarial, ser capaç d'aplicar les eines estadístiques i economètriques adequades per a l'anàlisi de l'empresa i el seu entorn.
2. CE2.3.7 Conèixer les fonts de dades estadístiques i econòmiques rellevants així com les eines d'anàlisi adequades per preparar la presa de decisions en empreses i organitzacions, especialment en els nivells operatiu i tàctic.
3. CE2.4 Defensar les solucions proposades d'una manera articulada a partir dels coneixements teòrics i tècnics adquirits.

Genèriques

1. CG4 Capacitat per utilitzar habitualment una variada gamma d'instruments de tecnologia de la informació i les comunicacions.
2. CG5 (CB3) Tenir la capacitat de reunir i interpretar dades rellevants per emetre judicis que incloguin una reflexió sobre temes rellevants d'índole social, científica o ètica.

Continguts

Continguts temàtics

Tema 1. Inferència estadística

Conceptes bàsics.

Estimació de paràmetres.

Contrastació d'hipòtesis.

Tema 2. El model de regressió lineal simple

Especificació.

Estimació.

Avaluació.

Inferència.

Predicció.





Tema 3. El model de regressió lineal múltiple
Especificació.

Estimació.

Avaluació.

Inferència.

Predicció.

Tema 4. El model de regressió amb variables explicatives qualitatives
Variables fictícies.

Interaccions.

Variables fictícies estacionals.

Tema 5. Errors d'especificació i problemes amb la mostra
Inclusió de variables irrelevantes.

Exclusió de variables rellevants.

Canvi estructural i test de Chow.

Observacions atípiques.

Multicol·linealitat.

Tema 6. Incompliment dels supòsits bàsics sobre el terme de pertorbació
Contrast de normalitat de Jarque-Bera

Perturbacions no esfèriques

Conseqüències de l'estimació MQO.

El model de regressió lineal generalitzat. Estimació per Mínims Quadrats Generalitzats i per Mínims Quadrats Ponderats

Tema 7. Heteroscedasticitat

Naturalitat del problema.

Detecció de la heteroscedasticitat.

Estimació amb heteroscedasticitat.

Tema 8. Autocorrelació

Naturalitat del problema.

Detecció de l'autocorrelació.

Estimació amb autocorrelació.

Metodologia docent

Activitats de treball presencial





Any acadèmic	2012-13
Assignatura	21205 - Econometria
Grup	Grup 68, 1S, Menorca, GADE
Guia docent	C
Idioma	Català

Modalitat	Nom	Tip. agr.	Descripció
Classes teòriques	Classes magistrals	Grup gran (G)	Les classes magistrals donen una exposició detallada del més important en cada tema, sobretot de conceptes nous. A més, tenen una funció d'ensenyar el més rellevant de cada apartat, però també permetre un enfocament especial en temes més complexos, on l'estudiant en general necessita més suport en el procés d'aprenentatge. Una altra funció important de les lliçons magistrals és facilitar als estudiants veure el context de cada tema i poder veure relacions entre les diferents parts del curs. Les classes teòriques consisteixen en 40 hores per a cada alumne (en mitjana).
Classes pràctiques	Sessions d'informàtica	Grup mitjà (M)	En finalitzar un tema teòric l'estudiant realitzarà sessions pràctiques per assimilar i aplicar la teoria repassada a classe. Les sessions pràctiques es basen en la utilització d'una macro economètrica en Excel. Aunqúe les mateixes tasques puguin ser realitzades en altres paquets informàtics, es pretén familiaritzar l'estudiant amb un mitjà que estarà present en la seva vida professional. Les classes pràctiques consisteixen en 16 hores per a cada alumne (en mitjana).
Avaluació	Examen final	Grup gran (G)	Es realitzarà un examen global per avaluar tots els coneixements adquirits. L'examen global tindrà una durada màxima de 2,5 hores.
Avaluació	Examen parcial	Grup gran (G)	Es realitzarà un examen parcial per avaluar els coneixements adquirits fins a la data de la seva realització. L'examen parcial tindrà una durada màxima de 1,5 hores.

Activitats de treball no presencial

Modalitat	Nom	Descripció
Estudi i treball autònom en grup	Preparació de les unitats didàctiques	És recomanable llegir el material corresponent abans d'assistir a les classes magistrals per facilitar l'aprenentatge del contingut. També és important revisar el temari després de cada classe per assegurar-se que tots els dubtes s'han solucionat. Estudiar la bibliografia i els recursos oferts pels professors és important per aprofundir l'aprenentatge i veure el context de cada apartat en el temari.
Estudi i treball autònom individual o en grup	Solució de pràctiques	Els estudiants rebran un material de dades amb determinades preguntes per solucionar. El treball consisteix a utilitzar la macro economètrica d'Excel per aplicar les tècniques economètriques estudiades i compondre un relatorio d'interpretacions i conclusions. És important no només mostrar el resultat final, sinó també explicar com s'ha arribat al resultat i la interpretació i conclusions que es poden fer. La pràctica pot lliurar com a treball individual o en grup, tot i que cada grup no pugui tenir més de tres integrants. En lliurar una pràctica en comú, els estudiants acceptem que tindran una mateixa nota per la pràctica lliurada.





Any acadèmic	2012-13
Assignatura	21205 - Econometria
Grup	Grup 68, 1S, Menorca, GADE
Guia docent	C
Idioma	Català

Riscs específics i mesures de protecció

Les activitats d'aprenentatge d'aquesta assignatura no comporten riscos específics per a la seguretat i salut de l'alumnat i, per tant, no cal adoptar mesures de protecció especials.

Estimació del volum de treball

Modalitat	Nom	Hores	ECTS	%
Activitats de treball presencial		60	2.4	40
Classes teòriques	Classes magistrals	40	1.6	26.67
Classes pràctiques	Sessions d'informàtica	16	0.64	10.67
Avaluació	Examen final	2.5	0.1	1.67
Avaluació	Examen parcial	1.5	0.06	1
Activitats de treball no presencial		90	3.6	60
Estudi i treball autònom en grup	Preparació de les unitats didàctiques	50	2	33.33
Estudi i treball autònom individual o en grup	Solució de pràctiques	40	1.6	26.67
Total		150	6	100

A començament del semestre hi haurà a disposició dels estudiants el cronograma de l'assignatura a través de la plataforma UIBdigital. Aquest cronograma inclourà almenys les dates en què es faran les proves d'avaluació contínua i les dates de lliurament dels treballs. A més, el professor o la professora informará els estudiants si el pla de treball de l'assignatura es durà a terme a través del cronograma o per una altra via, inclosa la plataforma Campus Extens.

Avaluació de l'aprenentatge dels estudiants

L'avaluació de l'aprenentatge consisteix en un examen final i dues modalitats diferents d'avaluació contínua: 1) L'examen final és un examen escrit que es realitza en el període d'avaluació complementària i en el període d'avaluació extraordinària.

2) Al llarg del semestre es realitzen sessions pràctiques. En l'última setmana de classes abans de vacances (al desembre) es penjarà a Campus Extens un enunciat de tasques pràctiques a realitzar amb un fitxer de dades que es penja també a Campus Extens. Les respostes es lliuren electrònicament a través de Campus Extens, individualment o en grup amb un màxim de tres integrants, fins a l'últim dia de classe abans d'exàmens (al gener). Tots els membres d'un mateix grup tenen la mateixa nota per la pràctica que lliurin en comú. Les sessions pràctiques inclouran diferents temes del curs i les tasques pràctiques consistiran en l'aplicació de diverses tècniques econòmiques a les dades disponibilitzades pels professors. Les sessions pràctiques es realitzen amb programes informàtics que s'introdueixen en una sala d'ordinadors.

3) La segona modalitat d'avaluació contínua serà un parcial amb el mateix format que l'examen final però incloent només els temes estudiats fins a la data de la seva realització (última setmana de classes abans de vacances al desembre).

L'estudiant tindrà una qualificació numèrica entre 0 i 10 per a cadascuna de les activitats avaluatives. La qualificació global es calcula tenint en compte pesos diferents per a les diferents formes d'avaluació.





Any acadèmic	2012-13
Assignatura	21205 - Econometria
Grup	Grup 68, 1S, Menorca, GADE
Guia docent	C
Idioma	Català

Es considera aprovat l'alumne que aconseguixi una nota final mínima de 5, independentement de les notes obtingudes en cada modalitat d'avaluació.

Un alumne que no aconseguix aprovar el curs en el període d'avaluació complementària no pot recuperar ni la nota de la tasca pràctica ni la nota de l'examen parcial i es presentarà en el període d'avaluació extraordinària a un examen global que representarà el 50% de la qualificació final.

Un alumne serà considerat no presentat si es presenta a un nombre d'activitats corresponent a un percentatge igual o inferior a 35% de la qualificació final. Si presenta una de les justificacions acceptades per la UIB (mort d'un familiar de primera línia directa, hospitalització de l'alumne o la seva participació en judici), l'alumne pot recuperar la nota de les activitats no presentades per aquest motiu. Aquesta possibilitat només existeix en els casos descrits i sempre serà exigint un comprovant de la situació.

Examen final

Modalitat	Avaluació
Tècnica	Proves de resposta llarga, de desenvolupament (Recuperable)
Descripció	Es realitzarà un examen global per avaluar tots els coneixements adquirits. L'examen global tindrà una durada màxima de 2,5 hores.
Criteris d'avaluació	Són fixats d'acord amb les competències requerides .

Percentatge de la qualificació final: 50% per l'itinerari A

Examen parcial

Modalitat	Avaluació
Tècnica	Proves de resposta llarga, de desenvolupament (No recuperable)
Descripció	Es realitzarà un examen parcial per avaluar els coneixements adquirits fins a la data de la seva realització. L'examen parcial tindrà una durada màxima de 1,5 hores.
Criteris d'avaluació	Són fixats d'acord amb les competències requerides .

Percentatge de la qualificació final: 35% per l'itinerari A

Solució de pràctiques

Modalitat	Estudi i treball autònom individual o en grup
Tècnica	Informes o memòries de pràctiques (No recuperable)
Descripció	Els estudiants rebran un material de dades amb determinades preguntes per solucionar. El treball consisteix a utilitzar la macro economètrica d'Excel per aplicar les tècniques econòmiques estudiades i compondre un relatori d'interpretacions i conclusions. És important no només mostrar el resultat final, sinó també explicar com s'ha arribat al resultat i la interpretació i conclusions que es poden fer. La pràctica pot lliurar com a treball individual o en grup, tot i que cada grup no pugui tenir més de tres integrants. En lliurar una pràctica en comú, els estudiants acceptem que tindran una mateixa nota per la pràctica lliurada.
Criteris d'avaluació	Són fixats d'acord amb les competències requerides .

Percentatge de la qualificació final: 15% per l'itinerari A

Recursos, bibliografia i documentació complementària

Bibliografia bàsica

ARCARONS, J. y CALONGE, S. (2008), "Microeconometría: introducción y aplicaciones con software econométrico para Excel", Delta Publicaciones.





Any acadèmic	2012-13
Assignatura	21205 - Econometria
Grup	Grup 68, 1S, Menorca, GADE
Guia docent	C
Idioma	Català

HILL, R. C., GRIFFITHS, W.E. y LIM, G. C. (2012), "Principles of Econometrics", Wiley, 4ª edició.

NOVALES, A. (1996): "Estadística y Econometría". McGraw-Hill.

WOOLDRIDGE, J. M. (2006), "Introducción a la Econometría: un enfoque moderno", Thomson, 2ª edició.

Bibliografia complementària

ASHENFELTER, O., LEVINE, P. B. y ZIMMERMAN, D. J. (2006). "Statistics and Econometrics: methods and applications", Wiley.

GREENE, W. H. (2007), Análisis Econométrico, Addison-Wesley / Prentice Hall, 6ª edició.

GUJARATI, D. (2009), "Econometría", McGraw-Hill, 5ª edició.

KENNEDY, P. (2003), "Introducción a la Econometría", Fondo de Cultura Económica.

MADDALA, G. S. (1992), "Introducción a la Econometría", Prentice Hall, 2ª edició.

NEWBOLD P., CARLSON, W. y THORNE, B. (2009), "Estadística para los negocios y la economía", Addison-Wesley / Prentice Hall, 7ª edició.

Altres recursos

