

**FITXA IDENTIFICATIVA****Dades de l'Assignatura**

Codi	35820
Nom	Econometria
Cicle	Grau
Crèdits ECTS	6.0
Curs acadèmic	2016 - 2017

Titulació/titulacions

Titulació	Centre	Curs	Període
1313 - Grau d'Administració i Direcció d'Empreses	Facultat d'Economia	3	Primer quadrimestre
1330 - Grau en Administració i Direcció d'Empreses (Ontinyent)	Facultat d'Economia	3	Primer quadrimestre
1921 - Programa Doble Titulació ADE-Dret	Dobles Títols Facultat de Dret - Facultat d'Economia	4	Primer quadrimestre

Matèries

Titulació	Matèria	Caràcter
1313 - Grau d'Administració i Direcció d'Empreses	18 - Econometria	Obligatòria
1330 - Grau en Administració i Direcció d'Empreses (Ontinyent)	18 - Econometria	Obligatòria
1921 - Programa Doble Titulació ADE-Dret	5 - Assignatures obligatòries de quart curs	Obligatòria

Coordinació

Nom	Departament
BELAIRE FRANCH, JORGE	10 - Anàlisi Econòmica
MOLTO CARBONELL, M LUISA	10 - Anàlisi Econòmica
RICO BELDA, PAZ	10 - Anàlisi Econòmica



RESUM

L'assignatura d'Econometria s'impartix en el primer semestre del tercer curs del Grau de Direcció i Administració d'Empreses, emmarcant-se en el conjunt de matèries que els estudiants han de cursar del mòdul de Mètodes Quantitatius.

Té caràcter obligatori i semestral, amb una càrrega lectiva total de 6 crèdits (150 hores).

L'objectiu de l'assignatura és proporcionar als estudiants els coneixements bàsics d'una disciplina acadèmica com és l'Econometria, que unix conceptes provinents de la Teoria Econòmica, de les Matemàtiques i de l'Estadística i el fi de la qual serà dotar a l'estudiant d'uns instruments analítics i quantitatius adequats per a abordar l'anàlisi de la realitat econòmica i empresarial. Entre els temes bàsics d'estudi en aquesta assignatura s'aborda l'estimació dels models de regressió, la formulació i contrastació d'hipòtesis en aquestos models, la realització de prediccions i els efectes i problemes que se segueixen del possible incompliment d'alguns dels supòsits formulats.

Com a disciplina de caràcter matemàtic -estadístic, els/les alumnes hauran d'utilitzar els coneixements previs de càlcul i estadística de matèries cursades amb anterioritat. És, per tant, una assignatura formativa amb un ampli espectre de continguts teòrics i pràctics que es recolza en habilitats prèvies i que els permet, amb el suport de certes ferramentes informàtiques, obtindre una visió integral dels instruments d'anàlisis quantitatius utilitzats en l'estudi i predicció de la realitat econòmica i empresarial.

El contingut essencial de l'assignatura se centra fonamentalment en el desenrotllament del model de regressió lineal, les seues hipòtesis i problemes associats. Per tant, el programa de l'assignatura conté, a més d'un primer bloc introductori, dos grans blocs: el model de regressió lineal amb un conjunt d'hipòtesis bàsiques i l'incompliment de dites hipòtesis i les seues implicacions.

CONEIXEMENTS PREVIS

Relació amb altres assignatures de la mateixa titulació

No heu especificat les restriccions de matrícula amb altres assignatures del pla d'estudis.

Altres tipus de requisits

Encara que no hi han requisits previs, es recomana haver cursat amb aprofitament les matèries de Matemàtiques I i II i Estadística I de primer curs, així com la assignatura d'Estadística II de segon curs, primer semestre.

COMPETÈNCIES

1313 - Grau d'Administració i Direcció d'Empreses

- Capacitat d'anàlisi i síntesi.



- Capacitat per a la resolució de problemes.
- Capacitat per a treballar en equip.
- Capacitat per a aplicar mètodes analítics i matemàtics per a l'anàlisi dels problemes econòmics i empresarials.

RESULTATS DE L'APRENTATGE

Els resultats esperats de l'aprenentatge de l'assignatura Econometria són els següents:

- Completar els coneixements en mètodes quantitatius proporcionats en cursos anteriors (Matemàtiques I, Matemàtiques II, Estadística I i Estadística II).
- Coneixement dels conceptes, tècniques i instruments econòmics bàsics associats al model de regressió lineal: l'anàlisi descriptiva i explorador de dades inicials, l'especificació del model de regressió, l'estimació dels seus paràmetres a partir de la informació mostral, l'anàlisi de l'adequació del model a la realitat estudiada i el contrast d'hipòtesis d'interès.
- Comprendre la dinàmica seqüencial d'especificació, estimació i validació dels models de regressió.

DESCRIPCIÓ DE CONTINGUTS

1. Models econòmics i dades econòmiques.

- 1.1. Concepte d'econometria.
- 1.2. Etapes en la modelització econòmica.
- 1.3. Dades econòmiques.

2. El model de regressió

- 2.1. El model de regressió lineal simple.
- 2.2. El model de regressió lineal múltiple.
- 2.3. Interpretació dels coeficients.
- 2.4. Unitats de mesura i formes funcionals.

3. Propietats i hipòtesis en el model de regressió

- 3.1. Propietats descriptives de la regressió: implicacions algebraiques de l'estimació.
- 3.2. Mesures de bondat de lajust: el coeficient de determinació i selecció de models (AIC).
- 3.3. Supòsits del model de regressió lineal clàssic.
- 3.4. Propietats probabilístiques del model.

**4. Contrast de hipòtesis en el model de regressió múltiple**

- 4.1. Introducció al contrast dhipòtesis
- 4.2. Contrast dhipòtesis sobre un únic paràmetre: lestadístic t
- 4.3. Contrastos dhipòtesis sobre un conjunt de paràmetres: lestadístic F.
- 4.4. Contrastos destabilitat estructural
- 4.5. Predicció puntual
- 4.6. Predicció per intervals

5. Anàlisi de regressió múltiple amb informació qualitativa

- 5.1. Les variables fictícies.
- 5.2. Interpretació de coeficients de variables fictícies.
- 5.3. Múltiples categories.
- 5.4. Interaccions de variables fictícies.

6. Incompliment de les hipòtesis bàsiques

- 6.1. Multicolinealitat .
- 6.2. Normalitat
- 6.3. Heterocedasticitat.
- 6.4. Autocorrelació.

VOLUM DE TREBALL

ACTIVITAT	Hores	% Presencial
Classes de teoria	30,00	100
Pràctiques en aula	30,00	100
Elaboració de treballs individuals	10,00	0
Estudi i treball autònom	40,00	0
Preparació d'activitats d'avaluació	15,00	0
Preparació de classes de teoria	7,00	0
Preparació de classes pràctiques i de problemes	18,00	0
TOTAL	150,00	

METODOLOGIA DOCENT

La metodologia per impartir l'assignatura d'Econometria anirà orientada a combinar la capacitat de treball individual amb la de treball en equip.



CLASSES TEÒRIQUES

A les classes teòriques el professorat realitzarà una exposició oral dels aspectes més importants del tema. A més, es proposaran, com a exercicis, extensions a realitzar per l'alumnat i que, posteriorment, seran corregides o resoltes en les classes pràctiques. Dites tasques complementàries hauran de presentar-se per escrit. L'alumnat prepararà amb antelació les lectures que serveixen de base per a l'explicació teòrica, així com els principals dubtes que sorgisquen de les citades lectures. Per tal cosa, disposaran d'una bibliografia bàsica recomanada d'acord amb el nivell del curs, així com de certes lectures complementàries que li permetran seguir sense problemes els diferents continguts.

CLASSES PRÀCTIQUES

A les classes pràctiques es pretén consolidar els conceptes adquirits en les classes teòriques mitjançant la resolució d'exercicis, problemes i l'estudi de casos.

Les classes pràctiques es basaran en una combinació de la resolució d'exercicis teòrics/pràctics i l'elaboració de models econòmics a partir de diferents casos pràctics, per la qual cosa s'emprarà un programari informàtic. Els fitxers dels exercicis seran disponibles a l'Aula Virtual.

Aquests exercicis, problemes i casos pràctics estaran dissenyats perquè els alumnes apliquen els coneixements i les habilitats adquirides en la classe de teoria a dades reals, de forma que completi el seu procés formatiu en el coneixement d'un instrumental analític i la seua posterior aplicació a l'elaboració d'un model econòmic.

El seguiment d'aquesta evolució de l'aprenentatge pràctic es realitzarà de forma contínua perquè permeti a l'estudiant avaluar l'evolució dels seus coneixements adquirits. El mètode de valoració principal serà la presentació periòdica d'exercicis i problemes resolts. També es valorarà la participació activa de l'estudiant en classe i la realització d'exercicis amb anterioritat a les classes.

AVALUACIÓ

L'assignatura s'avaluarà a través d'un doble procediment:

- 1.- Un examen final escrit de caràcter teòric/pràctic d'avaluació dels resultats de l'aprenentatge i la seua adequació a les competències de la matèria, amb una valoració del 80% de la qualificació final. S'exigirà un aprovat en la citada prova escrita, al marge de la qualificació obtinguda en els altres procediments d'avaluació, per a superar l'assignatura.
- 2.- El 20% restant de la qualificació serà el resultat d'avaluar de forma contínua la capacitat de l'estudiant per assimilar els coneixements i les destreses adquirides per resoldre problemes, realitzar treballs pràctics amb dades reals i exposar els resultats que obtinga. La citada qualificació englobarà tant l'elaboració de treballs en equip o individuals, presentats de forma escrita o oral com la resolució d'exercicis de forma individual, la realització de proves tipus test o la pròpia participació i implicació de l'estudiant en el procés d'ensenyança -aprenentatge.



En resum, la distribució de la qualificació final de l'estudiant serà la següent:

Realització d'exercicis teòric-pràctics i proves tipus test, així com la participació en classe 2 punts

Examen escrit al finalitzar el semestre (*) 8 punts

(*)Serà condició imprescindible per a la superació de l'assignatura aprovar l'examen escrit.

REFERÈNCIES

Bàsiques

- Uriel, E. (2013), Introducción a la Econometría, Manual electrónico, Valencia (<http://www.uv.es/~uriel/libroes.htm>)
- Wooldridge, J.M. (2006) Introducción a la Econometría. Un enfoque moderno. 2ª Edición. Thomson Paraninfo
- Uriel, E. (2013), Introduction to Econometrics, Electronic textbook, Valencia (<http://www.uv.es/~uriel/libroes.htm>)

Complementàries

- Uriel, E. y Gea, I. (1997). Econometría Aplicada, Editorial AC.
- Uriel, E., D. Contreras, M.L. Moltó y A. Peiró (1990). Econometría: El modelo lineal. Editorial AC.
- Gujarati, D.N., y Porter, D.C. (2010). Econometría. 5ª edición. McGraw-Hill.
- Contreras, D. y Belaire, J. (2000): Introducció a l'Econometria. Universitat de València.