

Econometria I (20844) (21134)

Titulació/estudi: AD/E Grau, IBE

Curs: 2

Trimestre: tercer

Nombre de crèdits ECTS: 5.0 crèdits

Hores de dedicació de l'estudiant: 100 hores

Llengua o llengües de la docència: Anglès i Castellà/Català

Professor: Christian Fons-Rosen i Stephan Litschig

1. Presentació de l'assignatura

Econometria I ensenya als estudiants com fer inferències quantitatives sobre efectes causals utilitzant dades transversals de tipus experimental i d'observació. La major part del curs està centrat en l'anàlisi de regressió múltiple com a eina per a mitigar el biaix, que es troba especialment en estudis observacionals.

2. Competències que s'han d'assolir

Aquest primer curs d'econometria permetrà a l'alumne familiaritzar-se amb els fonaments bàsics de l'anàlisi de regressió i els seus principals problemes. Tot això combinant una perspectiva analítica rigurosa i un ample conjunt d'exemples pràctics, resolts amb l'ajuda de paquets econòmics estàndar.

3. Continguts

Revisió d'estadística, Estimació i Inferència per a regressions bivariants, Estimació i Inferència per a regressions múltiples, models de regressió no lineals, Biaix de Causalitat Inversa, Biaix d'Error de Mesurament, Biaix de Selecció de la Mostra, Errors Correlacionats.

4. Avaluació

Conv. 3r. Trimestre: Exercicis: 15%; Participació: 15%; Examen Final: 70%.

La nota mínima a l'examen final de juny per aprovar l'assignatura es el 50% dels punts, és a dir, 5 punts sobre un total de 10 punts.

Conv. Setembre: Examen Final: 100%.

Hi haurà exercicis setmanals amb, com a mínim, un exercici empíric. Els exercicis tenen una ponderació de 15%. Les dades per resoldre els exercicis estaran disponibles a la pàgina web de l'assignatura. Els estudiants han d'entregar els exercicis solucionats en la data d'entrega, al principi de la classe teòrica corresponent. Els exercicis no es poden entregar electrònicament. Els exercicis entregats després del termini establert no seran avaluats.

Es recomana als estudiants treballar conjuntament amb altres per a resoldre els exercicis. **El número màxim d'estudiants a cada grup és 3. Cada grup presentarà una solució als exercicis i tots els estudiants del grup rebran la mateixa nota.** Sisplau, enumereu els noms dels estudiants que han treballat junts en el grup. Així mateix, s'han d'adjuntar els documents "log" de Stata a les solucions dels exercicis presentats. Els estudiants rebran tots els punts pels

exercicis que s'hagin intentat solucionar de manera “raonable” encara que les respostes finals siguin incompletes o incorrectes. Les notes dels exercicis estaran disponibles al Moddle al final de la setmana en que s'hagin entregat els exercicis. Reviseu les notes regularment per comprovar que son correctes. Les notes esdevindran definitives dues setmanes després de ser publicades a Internet.

L'assistència a les sessions de pràctiques serà controlada i contarà un 15% per la nota final de l'assignatura. Les solucions seran discutides durant les sessions de pràctiques. Al principi de la classe de pràctiques el professor us retornarà els exercicis per tal de que pugueu comprovar si les vostres respostes son correctes. Durant les classes de pràctiques, els estudiants tindran l'oportunitat d'obtenir punts “extra” (o bé de perdre'ls) depenent de la qualitat de les respostes donades a les preguntes fetes sobre els exercicis.

5. Bibliografia i recursos didàctics

5.1. Bibliografia bàsica

J.H. Stock i M.W. Watson, *Introduction to Econometrics* (segona edició, USA o internacional), Addison-Wesley, 2007. La primera edició també es pot utilitzar però es recomana la segona edició del llibre. El llibre està disponible a preus descomptats a diversos llocs d'Internet, com per exemple www.abebooks.com. Es recomana comprar el llibre no només per aquesta assignatura sinó també per Econometria II i altres assignatures i per a poder realitzar consultes en un futur. El llibre només està disponible en anglès.

6. Metodologia

Combinació de classes de teoria i sessions de pràctiques amb exercicis tant teòrics com de manipulació de dades.

El paquet estadístic utilitzat durant el curs serà Stata que està disponible als ordenadors de la UPF. Els estudiants han de consultar la guia de Stata que han preparat els professors per tal de familiaritzar-se amb aquest programa.

7. Programació d'activitats

				Classes:	Exercicis:
<u>Classe #</u>	<u>Data</u>	<u>Dia</u>	<u>Tema</u>	<u>SW Cap. #</u>	<u>Publicat Entrega</u>
1			Introducció i revisió d'estadística	2,3	
2			Revisió d'estadística	2,3	#1
			Introducció a Stata		
3			Regressió Bivariant I: Estimació	4	
4			Regressió Bivariant II: Estimació	4	#2 #1

	Pràctiques #1			
5	Regressió Bivariant III: Inferència	5	#3	#2
	Pràctiques #2			
6	Regressió Bivariant IV: Inferència	5		
7	Regressió Múltiple I: Estimació	6	#4	#3
	Pràctiques #3			
8	Regressió Múltiple II: Estimació	6		
9	Regressió Múltiple III: Inferència	7	#5	#4
	Pràctiques #4			
10	Regressió Múltiple IV: Inferència	7		
11	Regressió Múltiple V: Inferència	7	#6	#5
	Pràctiques #5			
12	Models de regressió no lineal I	8		
13	Models de regressió no lineal II	8	#7	#6
	Pràctiques #6			
14	Avaluació d'estudis de regressió I	9		
15	Avaluació d'estudis de regressió II	9	#8	#7
	Pràctiques #7			
16	Autocorrelació I			
17	Autocorrelació II			
18	Revisió/Tema Opcional			
	No hi ha pràctiques			