

Econometría I (20844) (21134)

Titulación/Estudio: Grado AD/E, IBE

Curso: Segundo

Trimestre: Tercero

Número de créditos ECTS: 5.0 créditos

Horas de dedicación del estudiante: 100 horas

Lengua o lenguas de la docencia: Inglés y Castellano/Catalán

Profesores: Christian Fons-Rosen / Stephan Litschig

1. Presentación de la asignatura

En Econometría I se instruye al alumno en métodos cuantitativos de estimación para desarrollar inferencias sobre efectos causales en la práctica, ya sea mediante el uso de datos observacionales o experimentales. Buena parte del contenido se ocupa del modelo de regresión lineal múltiple y su utilidad para mitigar sesgos, especialmente con datos observacionales.

2. Competencias que se han de obtener

Este primer curso de econometría permitirá al alumno familiarizarse con los fundamentos básicos del análisis de regresión y sus principales problemas. Todo ello combinando una perspectiva analítica riguroso y un amplio conjunto de ejemplo prácticos, resueltos eminentemente con la ayuda de paquetes econométricos estándares.

3. Contenidos

Revisión de Estadística, Estimación e Inferencia en el Modelo de Regresión Simple, Estimación e Inferencia en el Modelo de Regresión Múltiple, Modelos de Regresión No Lineales, Sesgo de Simultaneidad, Sesgo por Error de Medida, Sesgo por Selección de Muestras, Errores Correlacionados.

4. Evaluación

Conv. 3er Trimestre: Listas de Ejercicios: 15%; Participación: 15%; Examen Final: 70%.

La nota mínima en el examen final de junio para aprobar la asignatura es el 50% de los puntos, es decir, 5 puntos sobre un total de 10 puntos.

Conv. Septiembre: Examen Final: 100%

Cada semana el alumno entregará el desarrollo de listas de ejercicios entre los que al menos uno será empírico. Los datos e instrucciones para la solución de ejercicios estarán disponibles en la web de la asignatura. Los alumnos deberán entregar sus listas desarrolladas en la fecha indicada, al inicio de cada clase teórica. No se aceptará la entrega por correo electrónico ni fuera del plazo señalado. Las listas de ejercicios tienen un peso de 15% para la nota final.

Se recomienda el trabajo en grupo para el desarrollo de las listas de ejercicios, **se podrán formar grupos como máximo de 3 estudiantes los que deberán entregar sólo una solución** indicando claramente los nombres. Todos los miembros del grupo recibirán la misma nota. También se pedirá que los alumnos adjunten el archivo “log” de Stata. Los estudiantes recibirán

todos los puntos del ejercicio si se hace un intento “razonable” de solucionar el problema, aunque las respuestas sean incompletas o incorrectas. Las notas de las listas de ejercicios serán publicadas en Moodle al final de la semana en que se han entregado los ejercicios. Los alumnos deben mirar con regularidad las notas para asegurarse que las mismas se han registrado correctamente, dos semanas después de su publicación las notas serán definitivas.

La asistencia a los seminarios contará en un 15% para la nota final. Las soluciones a los ejercicios se discutirán durante las sesiones de prácticas. Al principio de la clase de prácticas, los profesores entregaran los ejercicios a los alumnos para que puedan comprobar si sus respuestas son correctas o no. Durante las clases prácticas, los alumnos también tendrán la oportunidad de obtener puntos “extra” (o bien perderlos) dependiendo de la calidad de las respuestas a preguntas que se harán a lo largo de los seminarios.

5. Bibliografía y recursos didácticos

5.1. Bibliografía básica

J.H. Stock and M.W. Watson, *Introduction to Econometrics* (second edition, US o international), Addison-Wesley, 2007. La primera edición también es válida, no obstante se recomienda la segunda. El libro está disponible a precios asequibles en diversas páginas web, como por ejemplo www.abebooks.com. Se recomienda comprar el libro pues será útil también para Econometría II, otros asignaturas y futuras consultas. El libro sólo está disponible en inglés.

6. Metodología

Combinación de sesiones de teórica con seminarios donde se discutirán ejercicios tanto prácticos como teóricos.

El paquete econométrico utilizado durante el curso es Stata que está disponible en los ordenadores de la UPF. Los estudiantes deben consultar la guía de Stata preparada por los profesores para familiarizarse con el programa.

7. Programación de actividades

<u>Clase #</u>	<u>Fecha</u>	<u>Día</u>	<u>Tema</u>	<u>Lecturas:</u>	<u>Ejercicios:</u>	
				<u>SW Cap. #</u>	<u>Publicado</u>	<u>Entrega</u>
1			Introducción y revisión de estadística	2,3		
2			Revisión de estadística	2,3	#1	
			Introducción a Stata			
3			Regresión Simple I: Estimación	4		
4			Regresión Simple II: Estimación	4	#2	#1

	Seminario #1			
	Regresión Simple III: Inferencia	5	#3	#2
	Seminario #2			
	Regresión Simple IV: Inferencia	5		
	Regresión Múltiple I: Estimación	6	#4	#3
5	Seminario #3			
	Regresión Múltiple II: Estimación	6		
6	Regresión Múltiple III: Inferencia	7	#5	#4
7	Seminario #4			
	Regresión Múltiple IV: Inferencia	7		
8	Regresión Múltiple V: Inferencia	7	#6	#5
9	Seminario #5			
	Modelos de Regresión No lineal I	8		
10	Modelos de Regresión No lineal II	8	#7	#6
11	Seminario #6			
	Evaluación de estudios de regresión I	9		
12	Evaluación de estudios de regresión II	9		#7
13	Seminario #7			
	Autocorrelación I			
14	Autocorrelación II			
15	No hay seminarios			
	No hay clase			
16	Repaso/Tema opcional			
17	No hay seminarios			

