

**FITXA IDENTIFICATIVA****DADES DE L'ASSIGNATURA**

Codi: 35942
Nom: Econometria
Cicle: Grau
Crèdits ECTS: 4,5
Curs acadèmic: 2026-27

TITULACIONS

Titulació	Centre	Curs	Període
1315 - Grau Finances i Comptabilitat	Facultat d'Economia	2	Segon quadrimestre

MATÈRIES

Titulació	Matèria	Caràcter
1315 - Grau Finances i Comptabilitat	Econometria	OBLIGATÒRIA

COORDINACIÓ

SERRANO DOMINGO GUADALUPE

RESUM

L'assignatura d'Econometria s'impartix en el segon semestre del segon curs del grau de Finances i Comptabilitat, 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 4,5 crèdits (1,5 teòrics i 3 informàtics/ pràctics).

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 l'estudiant d'uns instruments analítics i quantitatius adequats per a abordar l'anàlisi de la realitat econòmica - financera i empresarial. La formulació i contrastació d'hipòtesis sobre el funcionament d'eixa realitat, així com la realització de prediccions sobre el seu futur immediat seran l'objecte d'estudi en esta matèria.



Com a disciplina de caràcter matemàtic -estadístic, els estudiants hauran d'utilitzar els coneixements previs de càlcul i estadística que ja posseïxen d'altres matèries. És, per tant, una assignatura formativa amb un ampli espectre de continguts teòrics/pràctics que es recolza en habilitats prèvies dels estudiants i que els permet, amb el suport de certes ferramentes informàtiques, obtenir una visió integral dels instruments d'anàlisi quantitatives emprats en l'estudi i anàlisi de la realitat econòmica i empresarial.

El contingut essencial de l'assignatura se centra fonamentalment en el desenvolupament del model de regressió lineal, les seues hipòtesis i problemes associats. No obstant això, en el programa també s'inclou un tema essencial en el camp de les finances com és l'estudi de les sèries temporals, el seu concepte i estimació, si bé amb caràcter introductor. Per tant, el programa de l'assignatura es divideix en tres grans blocs: model de regressió lineal, incompliment de les hipòtesis bàsiques en el model de regressió lineal i introducció a les sèries temporals.

p>

CONEIXEMENTS PREVIS

RELACIÓ AMB ALTRES ASSIGNATURES DE LA MATEIXA TITULACIÓ

No s'ha especificat restriccions de matrícula amb altres assignatures del pla d'estudis.

ALTRES TIPUS DE REQUISITS

Sense requisits previs. Es recomana haver cursat les matèries de Matemàtiques I i II i Estadística I de primer curs, així com la d'Estadística II de segon curs, primer semestre.

COMPETÈNCIES / RESULTATS D' APRENTATGE

1315 - Grau Finances i Comptabilitat

CM3FYC 1 Conèixer el llenguatge estadístic i les capacitats i els límits del model estadístic per descriure una situació financera i empresarial.

CM3FYC 2 Conèixer i comprendre les eines estadístiques i econòmiques bàsiques per a la presentació, l'anàlisi, el diagnòstic i la prospecció de resultats financers i empresarials.

DESCRIPCIÓ DE CONTINGUTS



1. BLOC I. EL MODEL DE REGRESSIÓ LINEAL:

En aquest primer bloc s'introdueix el concepte d'econometria i s'analitza amb detall la que serà la referència bàsica d'aquest programa: el model de regressió lineal. En aquest sentit, s'analitzen els hipòtesis bàsiques i propietats d'aquest model, així com totes les etapes de la seua elaboració des de la perspectiva de la modelització economètrica, es a dir, la seua estimació, validació i predicció. Així mateix, s'analitzen totes les implicacions que d'ell es deriven quan incorporem el model informació qualitativa.

Tema 1. Models economètrics i dades econòmiques.

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

Tema 2. El model de regressió lineal.

- 2.1. El model de regressió lineal simple.
- 2.2. El model de regressió lineal múltiple.
- 2.3. Interpretació de coeficients: la clàusula ceteris paribus.
- 2.4. Unitats de mesura i formes funcionals.

Tema 3. Contrast de hipòtesis.

- 3.1. Propietats del model de regressió.
- 3.2. Mesures de bondat de l'ajuste.
- 3.3. Contrastos de hipòtesis.
- 3.4. Predicció.

Tema 4. Anàlisi de regressió múltiple amb informació qualitativa.

- 4.1. Les variables fictícies.
- 4.2. Interpretació de coeficients de variables fictícies.
- 4.3. Múltiples categories.
- 4.4. Interaccions de variables fictícies.

2. BLOC II. AMPLIACIÓ DEL MODEL LINEAL BÀSIC

Aquest bloc revisa els problemes i solucions del model de regressió lineal quan s'incomplixen algunes de les seues hipòtesis bàsiques.

Tema 5. Incompliment de les hipòtesis bàsiques.

- 5.1. Multicolinealitat i errors d'especificació.
- 5.2. Normalitat.
- 5.3. Heterocedasticidad.
- 5.4. Autocorrelació.

3. BLOC III. SÈRIES TEMPORALS

Aquest bloc se centra en el marc de la predicció en contextos d'incertesa, amb un tipus de dades específiques de l'anàlisi financera, com és les de les dades de sèrie temporal. Una anàlisi introductòria dels seus components, així com de l'estimació de les mateixes serà l'objecte d'aquest tema

Tema 6. Sèries temporals.

- 6.1. Introducció a l'anàlisi de sèries temporals.
- 6.2. Components no observables d'una sèrie temporal.

**VOLUM DE TREBALL (HORES)****ACTIVITATS PRESENCIALS**

Activitat	Hores
Teoria	15,00
Aula informàtica	30,00
Total hores	45,00

ACTIVITATS NO PRESENCIALS

Activitat	Hores
Assistència a altres activitats	0,00
Elaboració de treballs individuals o en grup	13,50
Estudi i treball autònom	10,00
Preparació de classes	23,00
Preparació d'activitats d'avaluació	12,00
Resolució de casos pràctics	9,00
Total hores	67,50

METODOLOGIA DOCENT

La metodologia per a impartir l'assignatura d'Econometria, tant en les classes teòriques com a pràctiques, anirà orientada a combinar una visió teòrica de la matèria, basada en la presentació, desenvolupament i coneixement de certs conceptes bàsics, amb un aprenentatge també molt pràctic, basat en l'ús d'instruments empírics que permeten l'anàlisi de diversos casos reals i pràctics davall distints escenaris. De forma més precisa, descrivim esta doble tipologia de la metodologia a continuació.

En les sessions teòriques es combinarà el disseny de classe magistral amb la participació activa de l'estudiant en classe (plantejament de dubtes que pot contestar el professor y/o els seus companys, resolució de qüestions breus plantejades pel professor, discussió en grup dels aspectes que han suscitat major interès i inclús xicotetes proves de repàs). Amb això es pretén que l'estudiant desenvolupe tant la seua capacitat de treball autònom, com la seua capacitat de defensar idees i la seua capacitat de comunicació oral i escrita (plantejant els seus dubtes sobre el tema en públic y/o resolent per escrit les qüestions que se li han plantejat).

Un bon seguiment de les classes teòriques exigirà que l'estudiant prepare amb antelació les lectures que servisquen de base per a l'explicació teòrica, així com els principals dubtes que sorgisquen de les citades lectures. En aquest context, l'alumne disposarà 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 del mateix. Igualment, tindrà accés a un cert material addicional (transparències, problemes teòrics, exercicis resolts i casos pràctics) en l'aula virtual de la Universitat.

Les classes pràctiques seguiran estratègies diverses, basades en la resolució de problemes i casos pràctics (reals/ficticis), emprant, si és el cas, per a això algun programari informàtic. Estos casos pràctics estaran dissenyats perquè l'estudiant aplic els coneixements i les destreses adquirides en la classe de teoria a dades reals/ficticis, de manera que completen el seu procés formatiu en el coneixement d'un



instrumental analític amb la seua posterior aplicació a l'elaboració de models econòmètrics. També es valorarà, en aquest sentit, la participació activa de l'estudiant en classe i la realització d'exercicis amb anterioritat a les classes, així com l'exposició pública de treballs, si fóra el cas i es considerarà oportú per part del professor acompanyar el format escrit del mateix amb una presentació oral.

considerarà oportú per part del professor acompanyar el format escrit del mateix amb una presentació oral.

AVALUACIÓ

En l'assignatura s'utilitzarà el següent procediment d'avaluació:

- Prova de síntesi (70% de la nota final): Prova escrita (examen) que constarà de qüestions teòriques i/o teoricopràctiques i/o de problemes sobre el contingut de l'assignatura.

- Avaluació contínua de l'estudiant a partir de la resolució d'exercicis i l'elaboració de treballs (30% de la nota final). Esta avaluació consistirà en la realització i presentació d'exercicis tant analítics com amb ordinador per a cada tema que anirà unida a la participació de l'estudiant en les classes pràctiques, així com al lliurament de qualsevol altre treball que el professor estime convenient realitzar al llarg del semestre. Esta avaluació contínua és de caràcter no recuperable, si bé la seua qualificació podrà guardar-se fins a la segona convocatòria en cas que l'estudiant no supere la prova de síntesi en la primera.

La nota final serà la suma ponderada de la prova de síntesi i de l'avaluació contínua (no recuperable). Per a sumar l'avaluació contínua és imprescindible superar la prova de síntesi.

En cas de no superar la prova de síntesi, la nota que figurarà en actes serà la nota obtinguda en esta prova (calculada sobre 10).

L'alumne sota sospita d'intent de còpia, plagi o suplantació en la realització dels lliuraments o de l'examen tindrà una nota final de zero.

La normativa oficial del centre respecte a avaluació i qualificació d'assignatures pot consultar-se en el següent enllaç:

https://www.uv.es/graus/normatives/2017_108_reglament_avaluacio_qualificacio.pdf

BIBLIOGRAFIA

- Carter Hill, R.; Griffiths, W. E. & Lim G.C. (2012): Principles of Econometrics. Fourth Edition. John Wiley & Sons. Inc.
- Contreras, D. y Belaire, J. (2000): Introducció a l'Econometria. Educació. Materials 36. Universitat de València.
- Gujarati, D. y Porter D.C. (2010) Econometría (5ª Edición). McGraw-Hill.



English version: Gujarati, D. and Porter D.C. (2009) Basic Econometrics, (5th Edition). McGraw-Hill

- Stock J.H. y Watson M.M. (2012) Introducción a la Econometría. (3ª Edition). Pearson
English version: Stock J.H. y Watson M.M. (2020) Introduction to Econometrics. (4th Edition, Global Edition). Pearson.
- Wooldridge, J (2016). Introducción a la econometría. 5ª Edición. Cengage Learning. English version: Wooldridge, J (2020). Introductory Econometrics: A Modern Approach 7th Edition. Cengage Learning

Recurs en línia, lliure accés:

<https://www.uv.es/uriel/manual/Introducci%C3%B3n%20a%20la%20econometr%C3%ADa%2012-09-2019%20B.pdf>