

**FITXA IDENTIFICATIVA****DADES DE L'ASSIGNATURA****Codi:** 44942**Nom:** Econometria**Cicle:** Màster Universitari Oficial**Crèdits ECTS:** 5**Curs acadèmic:** 2025-26**TITULACIONS**

Titulació	Centre	Curs	Període
2242 - Màster Universitari en Economia	Facultat d'Economia	1	Primer quadrimestre

MATÈRIES

Titulació	Matèria	Caràcter
2242 - Màster Universitari en Economia	Matèria Instrumental	OBLIGATÒRIA

COORDINACIÓ

BENEITO LOPEZ PILAR

BRETO MARTINEZ CARLES

RESUM

Este curs presenta els principals mètodes d'anàlisi economètrica i la seua aplicació a l'economia. L'objectiu principal del curs és ensenyar als estudiants com convertir-se en generadors i usuaris crítics de la investigació empírica. Açò s'aconsegueix enfocant-se tant en les propietats teòriques com en la implementació pràctica de les tècniques.

El curs comença introduint el model clàssic de regressió lineal, supòsits sobre les variables explicatives i les pertorbacions, les propietats de l'estimador de mínims quadrats i les proves d'hipòtesis. Esta primera part del curs tracta de proporcionar una base homogènia a tots els estudiants, aquells que tenen alguna capacitat en econometria de grau i aquells que no la tenen. Una segona part del curs introduïx les característiques de les pertorbacions no esfèriques i el model generalitzat de mínims quadrats, els problemes d'endogeneïtat i l'estimació de variables instrumentals, el mètode generalitzat de moments, el mètode de màxima versemblança i l'estimació d'equacions simultànies.

El curs també té com a objectiu desenrotllar les habilitats dels estudiants per a aplicar els mètodes a dades reals utilitzant el programa STATA.



CONEXEMENTS 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

Els estudiants es beneficiaran enormement de qualsevol curs introductori de pregrau d'econometria. No obstant això, el curs està orientat també a aquells sense coneixements previs d'econometria. Se suposa que els estudiants tenen quelcom de capacitat en ferramentes estadístiques bàsiques i àlgebra lineal / matricial, que s'utilitzen àmpliament en el curs.

COMPETÈNCIES / RESULTATS D' APRENENTATGE

-

Aplicar els coneixements adquirits en la identificació d'eixides professionals i jaciments d'ocupació, així com adquirir les habilitats personals que faciliten la inserció i desenrotllament professional. Per a això: conèixer i saber usar les tècniques i ferramentes de busca d'ocupació i considerar l'emprenimiento com una alternativa professional.

Conèixer les bases de dades i bibliogràfiques necessàries per a la realització de treballs d'investigació econòmica.

Obtindre capacitats lingüístiques i tecnològiques: capacitat per a utilitzar l'anglès en l'àmbit científic de l'economia i per a utilitzar les TIC en l'àmbit de l'estudi i la investigació de l'economia.

Posseir i comprendre coneixements que aportin una base o oportunitat de ser originals en el desenvolupament i / o aplicació d'idees, sovint en un context de recerca.

Que els estudiants posseïsquen les habilitats d'aprenentatge que els permeten continuar estudiant d'una forma que haurà de ser en gran manera autodirigida o autònoma.

Saber manejar bases de dades i el seu processament utilitzant les tècniques i els paquets informàtics més adequats i actuals.

Saber utilitzar adequadament les tècniques econòmiques aplicades a l'anàlisi del funcionament de l'economia.

DESCRIPCIÓ DE CONTINGUTS

1. REGRESSIÓ LINEAL AMB ERRORS i.i.d.



1. Econometria

1. REGRESSIÓ LINEAL AMB ERRORS i.i.d.

- 1.1 Introducció.
- 1.2 Estimació de MCO.
- 1.3 Contrastos Hipòtesi.
- 1.4 Variable Fictícies

2. REGRESSIÓ AMB ERRORS no-i.i.d.

- 2.1 Tipus de desviacions d'i.i.d. errors: heterocedasticidad i autocorrelació
- 2.2 Errors robustos.
- 2.3 L'estimador de mínims quadrats generalitzat, GLS (i GLS factible).

3. MODELS D'EQUACIONS SIMULTÀNIES

- 3.1 La naturalesa dels models d'equacions simultànies.
- 3.2 Caire de simultaneïtat en OLS.
- 3.3 Identificació i estimació d'una equació estructural.

4. ENDOGENEIDAD

- 4.1 Endogeneidad en les relacions econòmiques.
- 4.2 Estimació de variables instrumentals i 2SLS.
- 4.3 Proves de sobreidentificació.
- 4.4 Proves de rellevància dels instruments.
- 4.5 Proves d'endogeneidad.

5. MÈTODES D'IDENTIFICACIÓ CAUSAL BASATS EN 'EL CONTRAFACTUAL'

- 5.1 Intuïció: "Què hauria passat si...?". Paral·lelisme amb les dades experimentals.
- 5.2 Alguns estimadors de 'disseny': Estimadors de 'aparellament' (matching), estimació dif-in-dif, regressió en discontinuïtat i el mètode de control sintètic.
- 5.3 Condicions necessàries en cada cas per a "validar" el mètode.

6. ESTIMACIÓ PER MÀXIMA VERSEMBLANÇA

- 6.1 Introducció.
- 6.2 Marc general per a l'estimació condicional de màxima versemblança (CMV).
- 6.3 Consistència de CMV.
- 6.4 Normalitat asimptòtica i estimació de variància asimptòtica.
- 6.5 Contrastos basats en l'estimació de MV

Sessions pràctiques: INTRODUCCIÓ A STATA

- Introducció a elements bàsics.
- Obtindre les dades en STATA.
- Transformacions de dades comunes.
- Organització i maneig de dades econòmiques.
- Aplicació de mètodes.

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

Activitat	Hores
Teoria	40,00
Pràctiques a l'aula	10,00
Total hores	50,00

ACTIVITATS NO PRESENCIALS

Activitat	Hores
Assistència a altres activitats	0,00
Elaboració de treballs individuals o en grup	0,00
Estudi i treball autònom	75,00
Preparació de classes	0,00
Preparació d'activitats d'avaluació	0,00
Resolució de casos pràctics	0,00
Total hores	75,00

METODOLOGIA DOCENT

El curs s'impartix conferències de dos hores i un tutorial d'una hora i mitja (o classe pràctica) per setmana.

- Les conferències se centraran en la presentació dels conceptes i models teòrics. Per a este propòsit, els estudiants comptaran amb el material proveït pel professor abans de les conferències. Seguir els llibres de text també és essencial per a complementar les conferències teòriques.

- Les classes pràctiques estaran orientades a desenrotllar les habilitats dels estudiants per a aplicar la teoria a dades reals utilitzant el programari del curs STATA. Els estudiants hauran de resoldre alguns exercicis (exercicis analítics i de computadora) tant abans de la classe com durant el temps de classe.

nt el temps de classe.

AVALUACIÓ

Este curs utilitzarà el següent procediment d'avaluació:

- Examen final (70% de la nota final): Examen escrit, consistent en qüestions i/o problemes teòrics i/o teórico-pràctics.

- Avaluació contínua de l'alumne basada en 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 informàtics de cada assignatura, que estaran vinculats a la participació de l'alumne en les classes pràctiques, així com el lliurament de qualsevol altre treball que el professor estime oportú realitzar al llarg del semestre. Esta



avaluació contínua no és recuperable, encara que es podrà mantindre la nota fins a la segona convocatòria en el cas que l'alumne no supere l'examen final en la primera convocatòria.

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

En cas de suspendre l'examen final, la nota que apareixerà en les llistes oficials serà l'obtinguda en este examen (calculada sobre 10).

Els alumnes sospitosos d'intent de còpia, plagi o suplantació d'identitat en el lliurament de treballs o en l'examen rebran una qualificació final de zero.

La normativa oficial del centre relativa a l'avaluació i qualificació de les assignatures pot consultar-se en el següent enllaç:

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

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

BIBLIOGRAFIA

- Wooldridge, J.M. (2013). *Introductory Econometrics: A Modern Approach*, 5th edition. Cengage Learning (Previous editions: 2009, 2006, 2003).
- Greene, W.H. (2012). *Econometric Analysis*, 7th edition. Prentice Hall.
- Baum, Ch. F. (2006). *An Introduction to Modern Econometrics Using STATA*. STATA-Press.
- Wooldridge, J.M. (2002). *Econometric Analysis of Cross-Section and Panel Data*. The MIT Press.
- Stock J.H. and Watson M.M. (2020) *Introduction to Econometrics*. (4th Edition, Global Edition). Pearson.
- Econometrics in YouTube (last accessed July 2024): https://www.youtube.com/playlist?list=PLwJRxp3blEvZyQBTTOMFRP_TDaSdly3gU