

Año académico	2016-17
Asignatura	11633 - Econometría para Datos Masivos
Grupo	Grupo 1, 1S
Guía docente	A
Idioma	Castellano

Identificación de la asignatura

Asignatura	11633 - Econometría para Datos Masivos
Créditos	2,4 presenciales (60 horas) 3,6 no presenciales (90 horas) 6 totales (150 horas).
Grupo	Grupo 1, 1S (Campus Extens)
Período de impartición	Primer semestre
Idioma de impartición	Castellano

Profesores

Profesor/a	Horario de atención a los alumnos					
	Hora de inicio	Hora de fin	Día	Fecha inicial	Fecha final	Despacho
Jan Olof William Nilsson - william.nilsson@uib.es	11:00	12:00	Viernes	01/09/2016	28/07/2017	DB257
Andreu Sansó Rosselló andreu.sanso@uib.es	15:00	16:00	Martes	13/09/2016	07/02/2017	DB227. Cita prèvia per e-mail
	14:00	15:00	Miércoles	12/09/2016	16/01/2017	DB 219 (Econometría GADE 61)
Victor Emilio Troster - victor.troster@uib.es	18:30	19:00	Miércoles	12/09/2016	16/01/2017	DB 219 (Macroeconometría GECO 42)
	19:00	19:30	Lunes	12/09/2016	16/01/2017	DB 219 (Macroeconometría GECO 42)

Contextualización

La asignatura de Econometría para Datos Masivos es una asignatura de carácter obligatorio. La asignatura tiene un total de cinco temas, divididos en tres partes. La primera parte consta de un tema dedicado a los modelos de regresión lineal, mínimos cuadrados parciales, métodos recursivos de estimación y modelos de variables instrumentales. La segunda parte consta de tres temas, dedicados a métodos de reducción de variables (*shrinkage*), validación de modelos y predicción con muchos regresores. La tercera parte consiste en un tema dedicado a la utilización de modelos no-paramétricos y semi-paramétricos en Econometría. El curso es especialmente útil para introducir al alumno en algunas de herramientas más utilizadas en trabajos empíricos de investigación en los que se utilizan *machine learning*.

Año académico	2016-17
Asignatura	11633 - Econometría para Datos Masivos
Grupo	Grupo 1, 1S
Guía docente	A
Idioma	Castellano

En el contexto de los Métodos Económicos Cuantitativos, el curso de Econometría para Datos Masivos se presenta como la continuación de la formación estadística y econométrica básica. Concretamente, la asignatura introduce al alumno a las herramientas econométricas necesarias para el análisis de los datos masivos.

Requisitos

Ningún requisito obligatorio.

Recomendables

Se recomienda que para seguir correctamente la asignatura Econometría para Datos Masivos se disponga de un conocimiento intermedio de probabilidad y técnicas estadísticas.

Competencias

El objetivo fundamental de esta asignatura es analizar las técnicas econométricas más relevantes para el tratamiento de datos masivos, tales como mínimos cuadrados parciales, métodos recursivos de estimación, técnicas para el tratamiento de "fat data" y predicción.

Específicas

- * CE1. Aplicar las técnicas econométricas más relevantes para el tratamiento de datos masivos.
- * CE2. Contribuir a la buena gestión de la asignación de recursos (tanto en el ámbito privado como en el público).
- * CE3. Aportar racionalidad al análisis y a la descripción de cualquier aspecto de la realidad económica.

Genéricas

- * CG3. Aplicar al análisis de los problemas criterios profesionales basados en el manejo de instrumentos.
- * CG5. Analizar los problemas con razonamiento crítico, sin prejuicios, con precisión y rigor.
- * CG7. Capacidad de síntesis.

Básicas

- * Se pueden consultar las competencias básicas que el estudiante tiene que haber adquirido al finalizar el máster en la siguiente dirección: http://estudis.uib.cat/es/master/comp_basiques/

Contenidos

Parte 1. Modelos Lineales (1 tema)

En esta primera parte el alumno aprenderá las técnicas básicas de econometría para datos masivos. En concreto se analizan modelos lineales, mínimos cuadrados parciales, métodos recursivos de estimación y métodos de variables instrumentales

Parte 2: Métodos de Reducción, Validación de Modelos y Predicción con Muchos Regresores (3 temas)

Año académico	2016-17
Asignatura	11633 - Econometría para Datos Masivos
Grupo	Grupo 1, 1S
Guía docente	A
Idioma	Castellano

En la segunda parte se introduce al alumno en los aspectos relacionados con la reducción de variables (*Shrinkage*), validación de modelos, bootstrap y predicción con muchos regresores.

Parte 3: Modelos No-Paramétricos y Semi-Paramétricos en Econometría (1 tema)

En la tercera parte se introduce al alumno en los aspectos relacionados con la estimación no-paramétrica de funciones de densidad (método *Kernel*), estimación no-paramétrica de funciones de regresión y modelos semi-paramétricos.

Contenidos temáticos

1. Modelos Lineales
 - 1.1 Mínimos Cuadrados.
 - 1.2 Mínimos Cuadrados Parciales.
 - 1.3 Métodos Recursivos de Estimación.
 - 1.4 Métodos de Variables Instrumentales.
2. Métodos de Reducción (Shrinkage)
 - 2.1 Regresión Lineal para fat data.
 - 2.2 Regresión Ridge.
 - 2.3 Least Absolute Shrinkage and Selection Operator (LASSO).
3. Validación y Selección de Modelos
 - 3.1 Sesgo, Número de Parámetros y Varianza.
 - 3.2 Validación Cruzada (Cross-Validation) de Modelos.
 - 3.3 Métodos de Bootstrap.
4. Predicción con Muchos Regresores
 - 4.1 Variables Latentes y Análisis Factorial.
5. Modelos No-paramétricos y Semi-Paramétricos en Econometría
 - 5.1 Estimación no-paramétrica de funciones de densidad (Método Kernel).
 - 5.2 Estimación no-paramétrica de funciones de regresión.
 - * 5.2.1 Regresión lineal local.
 - * 5.2.2 Regresión polinómica local.
 - 5.3 Modelos semi-paramétricos.

Metodología docente

Volumen

Es recomendable leer el material correspondiente antes de asistir a las clases magistrales, para facilitar el aprendizaje del contenido. También es importante revisar el temario después de cada clase para asegurarse de que todas las dudas se han solucionado. Al finalizar un tema teórico el estudiante realizará ejercicios y prácticas para asimilar y aplicar la teoría expuesta en clase. Una parte de este trabajo se hace en clase, pero es importante que cada estudiante realice también estos estudios fuera de clase.



Año académico	2016-17
Asignatura	11633 - Econometría para Datos Masivos
Grupo	Grupo 1, 1S
Guía docente	A
Idioma	Castellano

Actividades de trabajo presencial

Modalidad	Nombre	Tip. agr.	Descripción	Horas
Clases teóricas	Clases teóricas	Grupo grande (G)	Las lecciones magistrales proporcionan una exposición detallada de lo más importante de cada tema, incluyendo conceptos nuevos, ejemplos y ejercicios ilustrativos. Las clases teóricas desarrollan los fundamentos estadísticos y econométricos de los modelos y herramientas analizadas. Una función importante de estas lecciones es la de facilitar que los estudiantes consideren las técnicas y modelos en el contexto del análisis económico aplicado. Por ello, además de fundamentar estadísticamente los modelos mediante su estudio teórico, las clases magistrales inciden en cómo evaluar y analizar los resultados econométricos, derivando a partir de los mismos las principales conclusiones económicas.	30
Clases prácticas	Clases prácticas	Grupo grande (G)	Para complementar la exposición de los temas teóricos, el estudiante realizará ejercicios y prácticas para asimilar y aplicar la teoría analizada en clase. Las sesiones prácticas también incluyen el uso del programa econométrico específico llamado R. Especialmente al finalizar cada uno de los temas, el alumno realizará aplicaciones prácticas con datos que ilustren el empleo de las técnicas.	28.5
Evaluación	Examen Parcial	Grupo grande (G)	Se realizará solamente un examen parcial durante el curso. Se valorará el conocimiento de los conceptos, técnicas y modelos expuestos en los cuatro primeros temas. La prueba será de carácter objetivo, valorándose tanto los conocimientos de tipo teórico, como la capacidad de interpretar y extraer resultados del análisis empírico.	1.5
Evaluación	Solución de Ejercicios	Grupo grande (G)	A cada dos semanas, el estudiante realizará ejercicios y prácticas para asimilar y aplicar la teoría desarrollada en clase.	0
Evaluación	Trabajo Final	Grupo grande (G)	Habrà un trabajo final en la convocatoria oficial. Esta evaluación permitirá valorar el conocimiento tanto teórico como aplicado de la econometría para datos masivos aplicada a datos que abarcan el programa (temas 1 a 5). Se valorará de manera objetiva tanto el nivel de conocimiento teórico, como la capacidad del alumno para interpretar y extraer conclusiones de los resultados obtenidos con los modelos y técnicas utilizadas.	0

Al inicio del semestre estará a disposición de los estudiantes el cronograma de la asignatura a través de la plataforma UIBdigital. Este cronograma incluirá al menos las fechas en las que se realizarán las pruebas de evaluación continua y las fechas de entrega de los trabajos. Asimismo, el profesor o la profesora informará a los estudiantes si el plan de trabajo de la asignatura se realizará a través del cronograma o mediante otra vía, incluida la plataforma Campus Extens.

Actividades de trabajo no presencial

Año académico	2016-17
Asignatura	11633 - Econometría para Datos Masivos
Grupo	Grupo 1, 1S
Guía docente	A
Idioma	Castellano

Modalidad	Nombre	Descripción	Horas
Estudio y trabajo autónomo individual	Preparación de unidades didácticas	Es recomendable leer el material correspondiente antes que asistir las clases magistrales para facilitar el aprendizaje del contenido. También es importante revisar el temario después de cada clase para asegurarse que todas las dudas se han solucionado. Estudiar la literatura y los recursos ofrecidos por los profesores es importante para profundizar en el aprendizaje y ver el contexto de cada apartado del temario.	90

Riesgos específicos y medidas de protección

Las actividades de aprendizaje de esta asignatura no conllevan riesgos específicos para la seguridad y salud de los alumnos y, por tanto, no es necesario adoptar medidas de protección especiales.

Evaluación del aprendizaje del estudiante

La evaluación del aprendizaje consiste en un trabajo final y una evaluación continua. El estudiante tendrá una calificación numérica entre 0 y 10 para cada una de las actividades evaluadas. La calificación global se calcula teniendo en cuenta los pesos asignados a las diferentes formas de evaluación.

El trabajo final es un trabajo escrito que se entrega en enero. A lo largo del semestre se realiza una sesión en la que cada estudiante, de forma individual, soluciona ejercicios con entrega al final de la sesión. La fecha de la sesión serán concretada al principio del semestre. Los alumnos que no asistan a la prueba parcial realizada durante el curso tendrán una calificación igual a 0 en dicha prueba. En el caso excepcional y debidamente documentado de que el alumno no pueda asistir a la prueba parcial por citación judicial a su persona, muerte de un familiar de primer grado u hospitalización del propio alumno, el porcentaje de la nota final previsto para dicha prueba parcial será trasladado al trabajo final.

A lo largo del semestre se pedirán a los estudiantes la resolución de hojas de ejercicios como parte de la nota de la evaluación continua.

Alguien que no consiga aprobar el curso en enero tiene la posibilidad de recuperar el trabajo final. Hay que tener en cuenta que únicamente el trabajo final es recuperable, pero que su peso en la nota final es sólo del 60%.

Si el alumno ha obtenido una nota final del curso en el periodo de evaluación ordinario igual o superior a 5, no existirá la posibilidad de mejorar su evaluación en el periodo extraordinario.

Examen Parcial

Modalidad	Evaluación
Técnica	Pruebas objetivas (no recuperable)
Descripción	Se realizará solamente un examen parcial durante el curso. Se valorará el conocimiento de los conceptos, técnicas y modelos expuestos en los cuatro primeros temas. La prueba será de carácter objetivo, valorándose tanto los conocimientos de tipo teórico, como la capacidad de interpretar y extraer resultados del análisis empírico.
Criterios de evaluación	Resolución de ejercicios sobre los conceptos, técnicas y modelos analizados en la asignatura.
Porcentaje de la calificación final:	20%

Año académico	2016-17
Asignatura	11633 - Econometría para Datos Masivos
Grupo	Grupo 1, 1S
Guía docente	A
Idioma	Castellano

Solución de Ejercicios

Modalidad	Evaluación
Técnica	Otros procedimientos (no recuperable)
Descripción	A cada dos semanas, el estudiante realizará ejercicios y prácticas para asimilar y aplicar la teoría desarrollada en clase.
Criterios de evaluación	Resolución de ejercicios sobre los conceptos, técnicas y modelos analizados en la asignatura.
Porcentaje de la calificación final:	20%

Trabajo Final

Modalidad	Evaluación
Técnica	Trabajos y proyectos (recuperable)
Descripción	Habrán un trabajo final en la convocatoria oficial. Esta evaluación permitirá valorar el conocimiento tanto teórico como aplicado de la econometría para datos masivos aplicada a datos que abarcan el programa (temas 1 a 5). Se valorará de manera objetiva tanto el nivel de conocimiento teórico, como la capacidad del alumno para interpretar y extraer conclusiones de los resultados obtenidos con los modelos y técnicas utilizadas.
Criterios de evaluación	Trabajo aplicado a datos que abarcan el programa (temas 1 a 5).
Porcentaje de la calificación final:	60%

Recursos, bibliografía y documentación complementaria

Además de los libros especificados en la bibliografía, durante todo el curso se pondrá a disposición de los alumnos material específico. Se podrá descargar material adicional de la página Web de la asignatura, donde se encontrarán colgados las prácticas, los ejercicios complementarios, explicaciones más detalladas de algunos temas concretos y también las notas de los alumnos en los trabajos que se vayan realizando a lo largo del curso.

Bibliografía básica

Hastie, T., Tibshirani, R., & Friedman, J. (2009): The elements of statistical learning (2nd edition). Springer, Berlin: Springer series in statistics.
James, G., Witten, D., Hastie, T., & Tibshirani, R. (2013). An introduction to statistical learning (Vol. 6). New York: Springer.

Bibliografía complementaria

Kuhn, M., & Johnson, K. (2013). Applied predictive modeling. New York: Springer.