

**FICHA IDENTIFICATIVA****Datos de la Asignatura**

Código	36112
Nombre	Econometría II
Ciclo	Grado
Créditos ECTS	6.0
Curso académico	2019 - 2020

Titulación(es)

Titulación	Centro	Curso	Periodo
1316 - Grado en Economía	Facultad de Economía	3	Segundo cuatrimestre

Materias

Titulación	Materia	Carácter
1316 - Grado en Economía	8 - Econometría	Obligatoria

Coordinación

Nombre	Departamento
SERRANO DOMINGO, GUADALUPE	10 - Análisis Económico

RESUMEN

La asignatura Econometría II tiene carácter obligatorio y semestral, con una carga lectiva total de 6 créditos ECTS (150 horas), impartándose en el tercer curso del Grado en Economía. La materia Econometría, comprende las asignaturas Econometría I y Econometría II, impartándose la primera en el primer semestre del curso y la segunda en el segundo semestre del curso. El objetivo de la materia es proporcionar a los estudiantes del Grado en Económicas los conocimientos básicos de la disciplina de Econometría, que aúna conceptos provenientes de la Teoría Económica, de las Matemáticas y la Estadística, y cuyo fin es proveer al economista de los instrumentos adecuados para abordar el análisis de la realidad económica y su evolución. Es por lo tanto una materia de gran nivel formativo, práctico y teórico que junto con la utilización de programas informáticos proporciona al alumno una visión integral de los instrumentos de análisis cuantitativo de la realidad económica y de predicción.



Los contenidos de la asignatura Econometría II se centran en la ampliación de conocimientos adquiridos en la Econometría I y en el estudio de algunos problemas econométricos especiales. Así en la Econometría II se estudia: la autocorrelación, los modelos dinámicos y los regresores estocásticos, el modelo de ecuaciones simultaneas, los modelos de variable dependiente cualitativa, las series temporales y los problemas de estacionariedad. Los estudiantes deberán utilizar conocimientos previos provenientes de diferentes materias que han cursado previamente: álgebra matricial, cálculo, estadística y econometría. Por último, la asignatura Econometría II se concibe como la continuación de la Econometría I, en la que se amplía y supera el modelo de regresión lineal ya que además de estudiar la violación de algunas de sus hipótesis básicas y se estudian de algunos tópicos de la econometría.

Así, esta asignatura genera el valor añadido de proporcionar un enfoque integrador y cuantitativo que permite la estimación y el contraste de los modelos establecidos por la Teoría Económica, aplicados a la problemática de la realidad económica analizada, o bien la predicción de su evolución. Ello dota al alumno de los instrumentos necesarios para el desarrollo de su actividad laboral futura, tanto si se centra en el asesoramiento y consultoría en el ámbito empresarial y privado, como si desarrolla su labor como economista en empresas e instituciones públicas.

CONOCIMIENTOS PREVIOS

Relación con otras asignaturas de la misma titulación

No se han especificado restricciones de matrícula con otras asignaturas del plan de estudios.

Otros tipos de requisitos

No se han especificado restricciones de matrícula con otras asignaturas del plan de estudios. Es recomendable que el alumno recuerde y maneje algunos conocimientos provenientes de las matemáticas, estadística, Teoría Económica y de la Econometría I.

COMPETENCIAS (RD 1393/2007) // RESULTADOS DEL APRENDIZAJE (RD 822/2021)

1316 - Grado en Economía

- Capacidad para la búsqueda y análisis de información.
- Capacidad para la toma de decisiones aplicando los conocimientos a la práctica.
- Capacidad de aprendizaje autónomo.
- Capacidad de manejar las tecnologías de la información.
- Comprender y aplicar el método científico, consistente en formular hipótesis, deducir resultados comprobables y contrastarlos con la evidencia empírica y experimental.



- Ser capaz de elaborar y defender un informe económico.
- Conocimiento y comprensión de las herramientas básicas de naturaleza cuantitativa para el análisis, diagnóstico y prospección económica, como lo son las matemáticas, la estadística y la econometría.

RESULTADOS DE APRENDIZAJE (RD 1393/2007) // SIN CONTENIDO (RD 822/2021)

El alumno adquirirá los conocimientos que le van a permitir el desarrollo de las siguientes actividades relacionadas con la investigación y el análisis económico:

- Búsqueda de información y conocimiento de fuentes estadísticas. Manejo de datos estadísticos.
- Familiarización con el manejo de bases de datos para el estudio de la economía.
- Abstracción y procesamiento de la información para su posterior utilización en paquetes informáticos.
- Identificación, clasificación, razonamiento, argumentación e interpretación de las relaciones entre variables económicas.
- Identificación de los problemas econométricos planteados en el modelo y aplicar los conocimientos teóricos para su correcto tratamiento.
- Selección de un marco teórico de referencia para el desarrollo del análisis.
- Extracción de información útil a partir de datos y modelos cuantitativos.
- Sintetizar, abstraer, aportar conclusiones o implicaciones económicas a partir del análisis realizado.
- Incremento de la capacidad de trabajo en equipo, dada la naturaleza de las decisiones descritas en los modelos.
- Estructuración y ejecución de un trabajo de investigación aplicado sobre un problema económico determinado.

DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS

1. Autocorrelacion

1. Naturaleza, causas y consecuencias del problema.
2. Formas de detectarla (Tests para detectar la autocorrelación).
3. Formas de solucionarla.

2. Modelos dinámicos

- 1 Regresores estocásticos de un modelo
- 2 Especificación de modelos dinámicos (el multiplicador)
- 3 Estimación de los modelos dinámicos: el estimador de V.I.



3. Modelos de ecuaciones simultáneas

- 1 Planteamiento de un modelo de ecuaciones simultáneas.
- 2 Causalidad y exogeneidad.
- 3 Identificación.
- 4 Estimación mediante V.I y MC2E

4. Variables dependientes cualitativas

- 1 Modelos de elección discreta.
- 2 Modelo lineal de probabilidad.
- 3 Modelos Logit, Probit.

5. Análisis de series temporales.

- 1 Componentes no observables de una serie temporal
- 2 Análisis de la tendencia
- 3 Análisis del comportamiento estacional
- 4 Modelización ARIMA
- 5 Identificación, estimación, validación y predicción

VOLUMEN DE TRABAJO

ACTIVIDAD	Horas	% Presencial
Clases de teoría	30,00	100
Prácticas en aula	30,00	100
Elaboración de trabajos en grupo	5,00	0
Elaboración de trabajos individuales	5,00	0
Estudio y trabajo autónomo	50,00	0
Preparación de clases de teoría	15,00	0
Preparación de clases prácticas y de problemas	15,00	0
TOTAL	150,00	

METODOLOGÍA DOCENTE

- En las clases teóricas se combina la exposición de la materia a tratar en cada sesión, apoyada con la proyección de resúmenes y con la resolución de ejercicios y casos prácticos propuestos por el profesor, para la mejor comprensión de la teoría.



- En las clases prácticas se resolverán ejercicios en la pizarra, por parte del profesor y del alumno y se realizarán ejercicios con el ordenador tanto de forma individual como en grupos.
- Además de consultar la bibliografía de referencia, el alumno dispondrá del material de trabajo elaborado para cada tema, tanto teórico como práctico, que se publicará en el aula virtual con la debida antelación.

Las tutorías se atenderán de forma individualizada o en grupo, en función de las cuestiones que se planteen en el estudio individual o en los trabajos en grupo de los alumnos.

Los trabajos prácticos irán orientados a la elaboración de un informe que explique los pasos realizados durante el análisis de un problema económico: planteamiento y motivación del problema y de su análisis, búsqueda de un modelo económico sencillo que relacione las variables relevantes del problema y búsqueda de información estadística sobre dichas variables. Se presentarán algunas de las bases de datos económicos tanto de carácter nacional como internacional (bases de datos electrónicas disponibles en la página web de la Biblioteca de CC sociales:

http://biblioteca.uv.es/valenciano/recursos_electronicos/bases_dades/acces.php; como el compendio estadístico de la OCDE o bases de datos de organismo nacionales o internacionales como en instituto Nacional de Estadística (www.ine.es) Eurostat (<http://ec.europa.eu/eurostat>) o Naciones Unidas (<http://unstats.un.org/unsd/default.htm>))

EVALUACIÓN

La asignatura utiliza el siguiente procedimiento de evaluación de competencias:

- **Prueba de síntesis:** Prueba escrita, consistente en un examen que constará de cuestiones teóricas y/o teórico-prácticas y/o de problemas sobre todo el contenido de la asignatura que figura en la Guía Académica. Esta prueba conformará el 70% de la nota del estudiante.
- **Evaluación continua del estudiante a partir de** la elaboración de informes breves, resolución de ejercicios o respuesta de cuestionarios sobre los contenidos que figuran en la Guía. Dicha evaluación se organizará en torno a la realización y presentación de un máximo de **3 entregas** que se solicitarán al alumno a lo largo del curso. Esta evaluación continua de carácter no recuperable conformará el 30% de la nota del estudiante.

Nota Final: la nota final será la **suma ponderada** de la prueba de síntesis y de la evaluación continua (no recuperable). Para sumar la evaluación continua es imprescindible superar la prueba de síntesis. En caso contrario la nota final de la asignatura no podrá superar un máximo de 4.5 puntos.



El alumno bajo sospecha de intento de copia, plagio o suplantación en la realización de las entregas o del examen tendrá una nota final de cero.

REFERENCIAS

Básicas

- Wooldridge, J (2015). Introducción a la econometría: un enfoque moderno. 5 ed. Cengage Learning.
- Cabrer B., Sancho a. y Serrano G. (2001): Microeconometría y decisión. Ed. Pirámide. Madrid.
- Wooldridge, J (2016) Introductory Econometrics: A modern approach. 6ed. Cengage Learning

Complementarias

- Stock J.H. y Watson M.M. (2012) Introducción a la Econometría. (3ª Ed.)
Greene, W. (1999). Análisis Econométrico (3 edición). Prentice-Hall. Madrid
- Gujarati, D. y Porter D.C. (2010) Econometría (5ª Edición). McGraw-Hill.

ADENDA COVID-19

Esta adenda solo se activará si la situación sanitaria lo requiere y previo acuerdo del Consejo de Gobierno

1. Contenidos

Se mantienen todos los contenidos inicialmente programados en la guía docente con excepción del tema 5. En este tema se reducen los contenidos inicialmente recogidos en la guía docente seleccionando los conceptos indispensables para adquirir las competencias.

2. Volumen de trabajo y planificación temporal de la docencia

La guía docente preveía 30 horas de clases presenciales de teoría y 30 de prácticas de las que restaba el 50% en el momento de inicio de la docencia no presencial.

Las 15 horas de clases presenciales se reasignan, acortando la duración de las videoconferencias o transparencias locutadas con contenidos teóricos entre 8 y 10 horas y trasladando el resto de horas de teoría al trabajo autónomo del estudiante con materiales adicionales subidos al aula virtual.



Las 15 horas de prácticas se reasignan destinando entre 8 y 10 horas a videoconferencias, clases grabadas o guías con contenidos correspondientes a las sesiones prácticas y evaluación continua programadas. El resto de horas se traslada al trabajo autónomo del estudiante con la elaboración de tareas periódicas adicionales a las ya programadas.

Se realiza una planificación semanal de los contenidos teóricos y prácticos que el alumno debe trabajar así como de las tareas periódicas que debe realizar como refuerzo de su aprendizaje y para realizar un seguimiento del trabajo del alumno. Las clases grabadas por videoconferencia o las guías de trabajo ofrecen al alumno una mayor flexibilidad a la hora de programar su trabajo semanal y se combinan con videoconferencias en la misma fecha y hora que las clases presenciales.

3. Metodología docente

Sustitución de la clase presencial por la creación de tareas “Videoconferencia” en el aula virtual, en la que se combinan semanalmente clases por videoconferencia síncrona - en día y hora de la clase presencial, grabación de transparencias locutadas y de sesiones prácticas mediante Blackboard Collaborate.

Subida al aula virtual de los materiales adicionales preparados para estas sesiones (guías, ejemplos y ejercicios resueltos) complementando los materiales que ya estaban previstos en la guía original para la docencia presencial (transparencias, ejercicios y cuestionarios prácticos). A modo de refuerzo, creación de actividades “tarea” periódicas de cada tema para facilitar e incentivar el seguimiento de la asignatura.

Las tutorías para atender las dudas se realizan por distintos medios, tales como correo electrónico, a través del foro del aula virtual y el programa de tutorías virtuales y/o combinado con sesiones de BB collaborate.

4. Evaluación

Dadas las características de la signatura y la planificación de tareas durante el curso, se mantiene la evaluación continua no recuperable de las tres entregas que consta en la guía docente original con un peso de un 30% en el total de la calificación. Asimismo, la prueba de síntesis supondrá un 70% del total de la calificación obtenida por el alumno.

Prueba de síntesis: Se basará en un examen que se subirá al aula virtual como “cuestionario” el día y hora previstos para el inicio del examen. El diseño del cuestionario se realizará a partir de la creación de un banco de preguntas, con resolución secuencial del mismo y tiempo limitado, tras el que se procederá a la entrega telemática del mismo. Se pedirá la identificación del estudiante y se monitorizará la realización del examen utilizando la videoconferencia BBC o similar en la medida en que sea viable. Con suficiente antelación se realizará al menos un cuestionario simulando las condiciones de examen online para practicar este tipo de prueba de síntesis.

Si una persona no dispone de los medios para establecer esta conexión y acceder al aula virtual, deberá contactar con el profesorado por correo electrónico en el momento de publicación de este anexo a la guía docente.

5. Bibliografía.



A los materiales previstos para la docencia presencial se añaden transparencias locutadas, ejercicios resueltos y grabaciones de sesiones de prácticas con el software previsto en la guía. Asimismo, como material complementario se proporcionan apuntes sobre algunos temas.

Para los temas 4 y 5, se emplaza a los alumnos a consultar los manuales propuestos en la bibliografía básica que pueden estar disponibles online.

Se les indica a los alumnos la posibilidad de acceder a una versión gratuita del software de prácticas en la página oficial del mismo.