FICHA IDENTIFICATIVA

Datos de la Asignatura

Código	36112
Nombre	Econometría II
Ciclo	Grado
Créditos ECTS	6.0
Curso académico	2022 - 2023

Titulación(es)

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

Materias

Titulación	Materia	Caracter
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), impartiéndose en el tercer curso del Grado en Economía. La materia Econometría, comprende las asignaturas Econometría I y Econometría II, impartiéndose 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 Econometria I y en el estudio de algunos problemas econométricos especiales. Asi 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 econometía. Por último, la asignatura Econometría II se concibe como la continuación de la Econometría I, en la que se amplia 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

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.
- Aplicar los principios del análisis económico (decisión racional) al diagnóstico y resolución de problemas.
- 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

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.
- Selección de un marco teórico de referencia para el desarrollo del análisis. Especificación del modelo econométrico.
- Identificación de los problemas econométricos planteados en el modelo. Aplicación de los conocimientos adquiridos para el correcto tratamiento de dichos problemas con la utilización de los instrumentos y técnicas econométricas apropiadas.
- Sintetizar, abstraer, aportar conclusiones o implicaciones económicas a partir del análisis realizado.
- Incremento de la capacidad de trabajo en equipo.
- Estructuración y ejecución de un trabajo de investigación aplicado sobre un problema económico determinado. Elaboración de un informe sobre dicho trabajo de investigación.

DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS

1. Autocorrelacion

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

2. Modelos dinámicos

1. Regresores estocásticos de un modelo.
2. Especificación de modelos dinámicos (el efecto multiplicador).
3. Estimación de los modelos dinámicos: el estimador de variables instrumentales (VI).

3. Modelos de ecuaciones simultáneas (MES)

1. Planteamiento de un modelo de ecuaciones simultáneas.
2. Identificación del MES.
3. Estimación mediante variables instrumentales (VI) y mínimos cuadrados en dos etapas (MC2E).

4. Variables dependientes cualitativas

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

5. Análisis de series temporales.

1. Componentes no observables de una serie temporal.
2. Análisis de la tendencia: modelos ARMA y ARIMA.
3. Análisis del comportamiento estacional: modelos SARSMA y SARISMA.
4. Modelización conjunta de las componentes: regular y estacional. Modelo ARIMA y SARISMA.
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.

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 exámen tendrá una nota fnal de cero.

REFERENCIAS

Básicas

- Wooldridge, J (2016). Introducción a la econometría, 5ª Edición. Cengage Learning
- Wooldridge, J (2020). Introductory Econometrics A Modern Approach. 7th Edition. Cengage Learning
- Cabrer B., Sancho a. y Serrano G. (2001): Microeconometría y decisión. Pirámide.

Complementarias

-
  - Stock J.H. y Watson M.M. (2019) Introduction to Econometrics, 4th Edition. Pearson.
  - Stock J.H. y Watson M.M. (2012) Introducción a la Econometría, 3ª Edición. Pearson.
  - Matilla M., Pérez P. y Sanz B. (2017) Econometría y Predicción, 2ª Edición. Mc Graw Hill.
  - Gujarati, D. y Porter D.C. (2010) Econometría, 5ª Edición. McGraw-Hill.
  - Greene, W. (2018). Econometric analysis, 8th Editon. Pearson.
  - Greene, W. (1999). Análisis Econométrico, 3ª Edición. Prentice-Hall.