

**FITXA IDENTIFICATIVA****Dades de l'Assignatura**

Codi	36112
Nom	Econometria II
Cicle	Grau
Crèdits ECTS	6.0
Curs acadèmic	2022 - 2023

Titulació/titulacions

Titulació	Centre	Curs	Període
1316 - Grau en Economia	Facultat d'Economia	3	Segon quadrimestre

Matèries

Titulació	Matèria	Caràcter
1316 - Grau en Economia	8 - Econometria	Obligatòria

Coordinació

Nom	Departament
SERRANO DOMINGO, GUADALUPE	10 - Anàlisi Econòmica

RESUM

L'assignatura Econometria II té caràcter obligatori i semestral, amb una càrrega lectiva total de 6 crèdits ECTS (150 hores), impartint-se en el tercer curs del Grau en Economia. La matèria Econometria, comprèn les assignatures Econometria I i Econometria II, impartint-se la primera en el primer semestre del curs i la segona en el segon semestre del curs. L'objectiu de la matèria és proporcionar als estudiants del Grau en Econòmiques els coneixements bàsics de la disciplina d'Econometria, que combina conceptes provinents de la Teoria Econòmica, de les Matemàtiques i l'Estadística, i la fi de la qual és proveir a l'economista dels instruments adequats per a abordar l'anàlisi de la realitat econòmica i la seva evolució. És per tant una matèria de gran nivell formatiu, pràctic i teòric que juntament amb la utilització de programes informàtics proporciona a l'alumne una visió integral dels instruments d'anàlisi quantitativa de la realitat econòmica i de predicció.

Els continguts de l'assignatura Econometria II se centren en l'ampliació de coneixements adquirits en la Econometria I i en l'estudi d'alguns problemes econòmics especials. Així, en l'Econometria II s'estudia: l'autocorrelació, els models dinàmics i els regressors estocàstics, el model d'equacions simultànies, els models de variable dependent qualitativa, les sèries temporals i els problemes d'estacionarietat. Els estudiants hauran d'utilitzar coneixements previs provinents de diferents matèries que han cursat prèviament: àlgebra matricial, càlcul, estadística i econometria. Finalment, l'assignatura



Econometria II es concep com la continuació de l'Econometria I, en la qual s' amplia i supera el model de regressió lineal ja que a més d'estudiar la violació d'algunes de les seves hipòtesis bàsiques i s'estudien d'alguns tòpics de l'econometria.

Així, aquesta assignatura genera el valor afegit de proporcionar un enfocament integrador i quantitatiu que permet l'estimació i el contrast dels models establerts per la Teoria Econòmica, aplicats a la problemàtica de la realitat econòmica analitzada, o bé la predicció de la seva evolució. Això dota a l'alumne dels instruments necessaris per al desenvolupament de la seva activitat laboral futura, tant si se centra en l'assessorament i consultoria en l'àmbit empresarial i privat, com si desenvolupa la seva labor com a economista en empreses i institucions públiques.

CONEIXEMENTS PREVIS

Relació amb altres assignatures de la mateixa titulació

No heu especificat les restriccions de matrícula amb altres assignatures del pla d'estudis.

Altres tipus de requisits

No s'han especificat restriccions de matrícula amb altres assignatures del pla d'estudis. És recomanable que l'alumne recordi i manegi alguns coneixements provinents de les Matemàtiques, Estadística, Teoria Econòmica i de l'Econometria I.

COMPETÈNCIES

1316 - Grau en Economia

- Capacitat per a la cerca i l'anàlisi d'informació.
- Capacitat per a la presa de decisions aplicant els coneixements a la pràctica.
- Capacitat d'aprenentatge autònom.
- Capacitat per manejar les tecnologies de la informació.
- Aplicar els principis de l'anàlisi econòmica (decisió racional) al diagnòstic i a la resolució de problemes.
- Comprendre i aplicar el mètode científic, consistent a formular hipòtesis, deduir resultats comprovables i confrontar-los amb l'evidència empírica i experimental.
- Ser capaç d'elaborar i defensar un informe econòmic.
- Coneixement i comprensió de les eines bàsiques de naturalesa quantitativa per a l'anàlisi, el diagnòstic i la prospecció econòmica, com ara les matemàtiques, l'estadística i l'econometria.



RESULTATS DE L'APRENTATGE

L'alumne adquirirà els coneixements que li permetran el desenvolupament de les següents activitats relacionades amb la recerca i l'anàlisi econòmica:

- Cerca d'informació i coneixement de fonts estadístiques. Maneig de dades estadístiques.
- Familiarització amb el maneig de bases de dades per a l'estudi de l'economia.
- Abstracció i processament de la informació per a la seva posterior utilització en paquets informàtics.
- Identificació, classificació, raonament, argumentació i interpretació de les relacions entre variables econòmiques.
- Selecció d'un marc teòric de referència per al desenvolupament de l'anàlisi. Especificació del model economètric.
- Identificació dels problemes econòmics plantejats en el model. Aplicació dels coneixements adquirits per al correcte tractament d'aquests problemes amb la utilització dels instruments i tècniques econòmiques apropiades.
- Sintetitzar, abstraure, aportar conclusions o implicacions econòmiques a partir de l'anàlisi realitzada.
- Increment de la capacitat de treball en equip.
- Estructuració i execució d'un treball de recerca aplicat sobre un problema econòmic determinat. Elaboració d'un informe sobre aquest treball de recerca.

DESCRIPCIÓ DE CONTINGUTS

1. Autocorrelació

1. Què és l'autocorrelació? Causes i conseqüències de l'autocorrelació.
2. Formes de detectar-la (Tests per a detectar l'autocorrelació).
3. Formes de solucionar el problema de l'autocorrelació.

2. Models dinàmics

1. Regressors estocàstics d'un model.
2. Especificació de models dinàmics (l'efecte multiplicador).
3. Estimació dels models dinàmics: l'estimador de variables instrumentals (VI).

3. Models d'equacions simultànies (MES)

1. Plantejament d'un model d'equacions simultànies.
2. Identificació del MES.
3. Estimació mitjançant variables instrumentals (VI) i mínims quadrats en dues etapes (MC2E).

**4. Variable dependent qualitativa**

1. Models de elecció discreta.
2. Model lineal de probabilitat.
3. Models Logit i Probit.

5. Anàlisi de sèrie temporal (Models ARIMA)

1. Components no observables d'una sèrie temporal.
2. Anàlisis de la tendència: models ARMA i ARIMA.
3. Anàlisis del comportament estacional: models SARSMA i SARISMA.
4. Modelització conjunta de les components regular i estacional: models ARIMA i SARISMA.
5. Identificació, estimació, validació i predicció.

VOLUM DE TREBALL

ACTIVITAT	Hores	% Presencial
Classes de teoria	30,00	100
Pràctiques en aula	30,00	100
Elaboració de treballs en grup	5,00	0
Elaboració de treballs individuals	5,00	0
Estudi i treball autònom	50,00	0
Preparació de classes de teoria	15,00	0
Preparació de classes pràctiques i de problemes	15,00	0
TOTAL	150,00	

METODOLOGIA DOCENT

- En les classes teòriques es combina l'exposició de la matèria a tractar en cada sessió, amb el suport de la projecció de resums i amb la resolució d'exercicis i casos pràctics proposats pel professor, per a la millor comprensió de la teoria.

- En les classes pràctiques es resoldran exercicis en la pissarra, per part del professor i de l'alumne i es realitzaran exercicis amb l'ordinador tant de forma individual com en grups.

- A més de consultar la bibliografia de referència, l'alumne disposarà del material de treball elaborat per a cada tema, tant teòric com pràctic, que es publicarà a l'aula virtual amb la deguda antelació.

Els treballs pràctics aniran orientats a l'elaboració d'un informe que expliqui els passos realitzats durant



l'anàlisi d'un problema econòmic: plantejament i motivació del problema i de la seva anàlisi, cerca d'un model econòmic senzill que relacioni les variables rellevants del problema i cerca d'informació estadística sobre aquestes variables. Es presentaran algunes de les bases de dades econòmics tant de caràcter nacional com internacional (bases de dades electròniques disponibles en la pàgina web de la Biblioteca de CC socials: http://biblioteca.uv.es/valenciano/recursos_electronicos/bases_dades/acces.php; com el compendi estadístic de l'OCDE o bases de dades d'organisme nacionals o internacionals com en institut Nacional d'Estadística (www.ine.es) Eurostat (<http://ec.europa.eu/eurostat>) o Nacions Unides (<http://unstats.un.org/unsd/default.htm>))

AVALUACIÓ

L'assignatura utilitza el següent procediment d'avaluació de competències:

Prova de síntesi. Prova escrita, consistent en un examen que constarà de qüestions teòriques i/o teoricopràctiques i/o de problemes al voltant de tot el contingut de l'assignatura que figura en la Guia Acadèmica. Esta prova conformarà el 70% de la nota de l'estudiant.

Avaluació contínua de l'estudiant a partir de l'elaboració d'informes breus, resolució d'exercicis o resposta de qüestionaris sobre els continguts que figuren en la Guia. La dita avaluació s'organitzarà entorn de la realització i presentació d'un màxim de **3 entregues** que se sol·licitaran a l'alumne al llarg del curs. Esta avaluació contínua de caràcter no recuperable conformarà el 30% de la nota de l'estudiant.

Nota Final: 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 contrari la nota final de l'assignatura no podrà superar un màxim de 4.5 punts.

L'alumne baix sospita d'intent de copia, plagi o suplantació en la realització de les entregues o de l'examen tindrà com a nota final un zero.

REFERÈNCIES

Bàsiques

- 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.



Complementàries

- 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 Económico, 3ª Edición. Prentice-Hall.