



Guía Docente

Datos Identificativos					2014/15
Asignatura (*)	Econometría II		Código	611G01027	
Titulación					
Descritores					
Ciclo	Período	Curso	Tipo	Créditos	
Grao	2º cuatrimestre	Terceiro	Obrigatoria	6	
Idioma	Castelán				
Prerrequisitos					
Departamento	Economía Aplicada 2				
Coordinación	Arranz Perez, Matilde	Correo electrónico	matilde.arranz@udc.es		
Profesorado	Arranz Perez, Matilde	Correo electrónico	matilde.arranz@udc.es		
Web					
Descrición xeral	Esta materia é unha ampliación da Econometría I que analiza diversos temas de gran interese teórico e aplicado para a especificación e estimación de modelos econométricos.				

Competencias da titulación

Código	Competencias da titulación

Resultados da aprendizaxe

Competencias de materia (Resultados de aprendizaxe)	Competencias da titulación		
Coñecer e comprender as consecuencias que sobre os estimadores do modelo clásico ten o incumprimento dalgunhas das súas hipóteses.	A1		C3
	A2		C4
	A3		C5
	A4		C6
	A7		C7
	A8		C8
	A9		
	A10		
	A12		
	A13		
Saber a forma en que un modelo econométrico pode incorporar información cualitativa.	A1		C3
	A2		C4
	A3		C5
	A4		C6
	A7		C7
	A8		C8
	A9		
	A10		
	A12		
	A13		



Coñecer e comprender a forma en que os modelos dinámicos e os de ecuacións múltiples poden ser especificados e estimados.	A1 A2 A3 A4 A7 A8 A9 A10 A12 A13		C3 C4 C5 C6 C7 C8
Coñecer e comprender a utilidade dos modelos econométricos para analizar as relacións económicas que se presentan na economía real.	A1 A2 A3 A4 A5 A6 A7 A8 A9 A10 A12		C3 C4 C5 C6 C7 C8
Utilizar ferramentas informáticas adecuadas para a aplicación das competencias anteriores.	A7 A9 A10		C3

Contidos	
Temas	Subtemas
1) As variables ficticias nos modelos econométricos.	1.1. Definición. 1.2. Incorporación das variables ficticias ao modelo. 1.3. Contrastes de estabilidade muestral. 1.4. O caso de estacionalidade.
2) Incumprimento dalgunhas hipóteses do modelo clásico.	2.1. Omisión de variable relevante. 2.2. Inestabilidade muestral paramétrica: contrastes de Chow e de residuos recursivos. 2.3. Non normalidade da perturbación.
3) Modelos dinámicos.	3.1. Modelos de retardos distribuídos. 3.2. Modelos autorregresivos. 3.3. Estimación de variables instrumentais.
4) Estimación de mínimos cadrados en dúas etapas (MC2E).	4.1. Modelos de ecuacións simultáneas. 4.2. Identificación do modelo. 4.3. Estimación de mínimos cadrados bietápicos. 4.4. O contraste de Hausman.
5) A Econometría Aplicada.	5.1. Econometría: os seus fins e procedemento. 5.2. Aplicacións dos modelos econométricos.

Planificación



Metodoloxías / probas	Horas presenciais	Horas non presenciais / traballo autónomo	Horas totais
Actividades iniciais	3	0	3
Sesión maxistral	17	34	51
Obradoiro	15	30	45
Prácticas a través de TIC	7	28	35
Proba mixta	2	9	11
Atención personalizada	5	0	5

*Os datos que aparecen na táboa de planificación son de carácter orientativo, considerando a heteroxeneidade do alumnado

Metodoloxías	
Metodoloxías	Descrición
Actividades iniciais	O curso comezará cunha sesión expositiva na que se presentará a materia, exporase con detalle o traballo a desenvolver polos alumnos e os criterios de avaliación e, repasarase os conceptos básicos das materias de Econometría anteriormente cursadas.
Sesión maxistral	Docencia expositiva consistente en leccións impartidas polos profesores, nas que se desenvolverá o contido teórico do programa mediante exposición oral complementada por medios audiovisuais.
Obradoiro	Docencia interactiva dedicada á solución de exercicios nos que se aplican os conceptos teóricos.
Prácticas a través de TIC	Sesións interactivas dedicadas á presentación e aplicación das ferramentas informáticas relacionadas cos contidos do programa.
Proba mixta	Realizaranse en clase algunhas probas para avaliar o grao de aprendizaxe. Poderán substituír, en todo, ou en parte, ao exame final. O número e a data delas determinarase, oportunamente, segundo o desenvolvemento do curso.

Atención personalizada	
Metodoloxías	Descrición
Obradoiro	- Resolución das dúbidas específicas de cada alumno que se poidan suscitar na comprensión dos conceptos teóricos ou na súa aplicación práctica.
Prácticas a través de TIC	- Adaptación do ensino das ferramentas informáticas ás características de cada alumno.
Proba mixta	- Sesións para preparar as probas obxectivas. - Tratamento de todas as cuestións relacionadas co traballo que os alumnos haxan de realizar como parte do proceso de aprendizaxe. - Formaranse dous subgrupos de 15 alumnos. Cada un deles terá unha tutoría de 4 horas de duración, repartidas en dúas sesións de 2 horas cada unha. Avisarase en clase, con antelación, sobre o lugar e a data en que se van a celebrar. - A atención prestarase nas horas de clase previstas para esta actividade e en horario de tutorías.

Avaliación		
Metodoloxías	Descrición	Cualificación
Obradoiro	Trátase da avaliación continua. Os alumnos deberán ter presenza activa nestas clases e deberán resolver e entregar os exercicios e cuestións que lles sexan propostos e na forma que lles será indicada.	30
Proba mixta	Trátase do exame final. Proba escrita para a avaliación da aprendizaxe. Poderá combinar distintos tipos de preguntas de tipo teórico e práctico.	70

Observacións avaliación



- 1) A cualificación de cada alumno obterase combinando os resultados da avaliación continua ao longo do período lectivo e a nota que obteña na proba obxectiva. A avaliación continua pondera un 30% da cualificación (máximo 3.0 puntos), e a proba obxectiva o restante 70% (máximo 7.0 puntos).
- 2) A proba obxectiva considérase fundamental na avaliación, polo que será necesario obter nela un mínimo de 2.5 puntos para superar a materia. O alumno que non alcance esta puntuación mínima, será cualificado cun máximo de 4 puntos.
- 3) En ningún caso a parte da nota correspondente á avaliación continua poderase obter no exame final. En calquera circunstancia, devandito exame suporá como máximo 7.0 puntos.
- 4) Segundo o Acordo marco para a elaboración das guías docentes do Centro:
 - 4.1 "A cualificación de Non Presentado se reserva exclusivamente ás persoas que só participasen en actividades que, en conxunto, supoñan menos do 20% da nota final". Por tanto, todos os alumnos que se presenten a actividades que supoñan un mínimo do 20% da nota final, calquera que sexa a puntuación obtida nas mesmas, terán unha cualificación numérica na materia.
 - 4.2. "Está prohibido o acceso á aula de exame con calquera dispositivo que permita o almacenamento de información ou a comunicación co exterior". Os alumnos que os traian, deberán apagalos e depositalos á entrada da aula antes do comezo da proba; os profesores non se fan responsables da súa perda ou extravío.

Fontes de información

Bibliografía básica	<ul style="list-style-type: none"> - Carrascal, U., González, Y. y Rodríguez, B. (2000). Análisis econométrico con EViews. Ra-ma - Guisán, M.C. (1997). Econometría. McGraw-Hill - Gujarati, D. y Porter, D. (2011). Econometría. McGraw-Hill - Ramil, M.: Rey, c.; Lodiero, M.; Arranz, M. (2012). Introducción a la Econometría. Noroeste S.L ISBN 13:978-84-92794-64-5 - Arranz, M. (2014). Material para el desarrollo de las clases . Moodle
Bibliografía complementaria	<ul style="list-style-type: none"> - Pena Trapero, J. et al (1999). Cien ejercicios de econometría. Pirámide - Matilla, M.; Pérez, P.; Sanz, B. (2013). Econometría y predicción. McGraw-Hill - Ramil, M. y Arranz, M. (2001). Modelos de ecuaciones simultáneas. ISBN 84-688-6034-4 - Pulido, A. y Pérez, J. (2001). Modelos econométricos. Pirámide

Recomendacións

Materias que se recomenda ter cursado previamente

Materias que se recomenda cursar simultaneamente

Materias que continúan o temario

Estadística I/611G01006
 Matemáticas I/611G01009
 Microeconomía e Mercados/611G01012
 Estadística II/611G01014
 Macroeconomía/611G01017
 Métodos Estadísticos e Introducción á Econometría/611G01019
 Econometría I/611G01022
 Matemáticas II/611G02010

Observacións

É moi importante que os alumnos estean familiarizados cos contidos das materias de Introducción á Econometría e Econometría I.

(*A Guía docente é o documento onde se visualiza a proposta académica da UDC. Este documento é público e non se pode modificar, salvo casos excepcionais baixo a revisión do órgano competente dacordo coa normativa vixente que establece o proceso de elaboración de guías