



## Teaching Guide

Identifying Data				2016/17	
Subject (*)	Econometría II	Code	611G01027		
Study programme	Grao en Economía				
Descriptors					
Cycle	Period	Year	Type	Credits	
Graduate	2nd four-month period	Third	Obligatoria	6	
Language	Spanish				
Teaching method	Face-to-face				
Prerequisites					
Department	Economía Aplicada 2				
Coordinador	Arranz Perez, Matilde	E-mail	matilde.arranz@udc.es		
Lecturers	Arranz Perez, Matilde	E-mail	matilde.arranz@udc.es		
Web					
General description	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.				

## Study programme competences / results

Code	Study programme competences / results
A1	CE1- Contribuír á boa xestión da asignación de recursos tanto no ámbito privado como no público.
A2	CE2-Identificar e anticipar problemas económicos relevantes en relación coa asignación de recursos en xeral, tanto no ámbito privado como no público.
A3	CE3-Aportar racionalidade á análise e á descripción de calquera aspecto da realidade económica.
A4	CE4-Avaliar consecuencias e distintas alternativas de acción e seleccionar as mellores, dados os obxectivos.
A5	CE5-Emitir informes de asesoramento sobre situación concretas da economía (internacional, nacional ou rexional) ou de sectores da mesma.
A6	CE6-Redactar proxectos de xestión económica a nivel internacional, nacional ou rexional. Integrarse na xestión empresarial.
A7	CE7-Identificar as fontes de información económica relevante e o seu contido.
A8	CE8-Entender as institucións económicas como resultado e aplicación de representacións teóricas ou formais acerca de cómo funciona a economía.
A9	CE9-Derivar dos datos información relevante imposible de recoñecer por non profesionais.
A10	CE10-Usar habitualmente a tecnoloxía da información e as comunicación en todo a seu desempeño profesional.
A11	CE11Leer e comunicarse no ámbito profesional en máis dun idioma, en especial en inglés.
A12	CE12-Aplicar á análise dos problemas criterios profesionais baseados no manexo de instrumentos técnicos.
A13	CE13-Comunicarse con fluidez no seu contorno e traballar en equipo.
B1	CB1 - Que os estudantes demostran posuir e comprender coñecementos nun área de estudo que parte da base da educación secundaria xeral, e que soe encontrar nun nivel que, aínda que se apoia en libros de texto avanzados, inclúe tamén algúns aspectos que implican coñecementos procedentes da vangarda do seu campo de estudo.
B2	CB2 - Que os estudantes saiban aplicar os seus coñecementos ó seu traballo ou vocación dun xeito profesional e posúan as competencias que se demostran por medio da elaboración e defensa de argumentos e a resolución de problemas dentro da su entorna de traballo.
B3	CB3 - Que os estudantes teñan a capacidade de reunir e interpretar datos relevantes (normalmente dentro da su área de estudo) para emitir xuízos que inclúan unha reflexión sobre temas relevantes de índole social, científica ou ética
B4	CB4 - Que os estudantes poidan transmitir información, ideas, problemas e solucións a un público tanto especializado como non especializado
B5	CB5 - Que os estudantes desenvolvesen aquelas habilidades de aprendizaxe necesarias para emprender estudos posteriores cun alto grao de autonomía
B6	CG1- Que os estudantes formados se convertan en profesionais capaces de analizar, reflexionar e intervir sobre os diferentes elementos que constitúen un sistema económico



B7	CG2 - Que os estudantes coñezan o funcionamento e as consecuencias dos sistemas económicos, as distintas alternativas de asignación de recursos, acumulación de riqueza e distribución da renda e estean en condicións de contribuír ao seu bo funcionamento e mellora
B8	CG3 -Que os estudantes sexan capaces de identificar e anticipar os problemas económicos relevantes, identificar alternativas de resolución, seleccionar as máis axeitadas e avaliar os resultados aos que conduce.
B9	CG4 -Que os estudantes respecten os dereitos fundamentais e de igualdade de oportunidades, non discriminación e accesibilidade universal das persoas con minusvalidez.
C1	CT1-Expresarse correctamente, tanto de forma oral coma escrita, nas linguas oficiais da comunidade autónoma.
C3	Utilizar as ferramentas básicas das tecnoloxías da información e as comunicacións (TIC) necesarias para o exercicio da súa profesión e para a aprendizaxe ao longo da súa vida.
C4	CT2-Desenvolverse para o exercicio dunha cidadanía aberta, culta, crítica, comprometida, democrática e solidaria, capaz de analizar a realidade, diagnosticar problemas, formular e implantar solucións baseadas no coñecemento e orientadas ao ben común.
C5	CT3-Entender a importancia da cultura emprendedora e coñecer os medios ao alcance das persoas emprendedoras.
C6	CT4-Valorar criticamente o coñecemento, a tecnoloxía e a información dispoñible para resolver os problemas cos que deben enfrontarse.
C7	CT5-Asumir como profesional e cidadán a importancia da aprendizaxe ao longo da vida.
C8	CT6-Valorar a importancia que ten a investigación, a innovación e o desenvolvemento tecnolóxico no avance socioeconómico e cultural da sociedade.

### Learning outcomes

Learning outcomes	Study programme competences / results		
Coñecer e comprender as consecuencias que sobre os estimadores MCO dos coeficientes do modelo clásico ten o incumprimento dalgunhas das súas hipóteses.	A1 A2 A3 A4 A7 A8 A9 A10 A12 A13	B1 B2 B3	C1 C3 C4 C5 C6 C7 C8
Saber a forma en que un modelo econométrico pode incorporar información cualitativa.	A1 A2 A3 A4 A7 A8 A9 A10 A12 A13	B3 B4 B5 B6	C3 C4 C5 C6 C7 C8



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	B9	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 A11 A12 A13	B1 B3 B7 B8 B9	C1 C3 C4 C5 C6 C7 C8
Utilizar ferramentas informáticas adecuadas para a aplicación das competencias anteriores.	A7 A9 A10		C3

Contents	
Topic	Sub-topic
1) Multicolinealidad	1.1. Concepto, causas e consecuencias. 1.2. Identificación do problema e posibles solucións. 1.3. A selección de regresores. 1.4. Erro de especificación: omisión de variables relevantes e/ou inclusión de variables irrelevantes.
2) As variables ficticias nos modelos econométricos.	2.1. Definición. 2.2. Incorporación das variables ficticias ao modelo. 2.3. O caso da estacionalidade. 2.4. Inestabilidade muestral paramétrica: contrastes de Chow e de residuos recursivos.
3) Modelos dinámicos.	3.1. Modelos de retardos distribuídos. 3.2. Modelos autorregresivos. 3.3. Estimación de modelos con regresores aleatorios: Variables Instrumentais.
4) Modelos de ecuacións simultáneas.	4.1. Os modelos multiecuacionais: introdución. 4.2. Modelos de ecuacións simultáneas: especificación e hipóteses. 4.3. Identificación do modelo. 4.4. Estimación de mínimos cadrados bietápicos. 4.5. O contraste de Hausman.

**Planning**



Methodologies / tests	Competencies / Results	Teaching hours (in-person & virtual)	Student?s personal work hours	Total hours
Introductory activities	A2 A7 A9 A11 B1	3	0	3
Guest lecture / keynote speech	A9 A11 B2 B8 B9	17	34	51
Workshop	A1 A3 A4 A8 A13 B3 B4 C1 C4 C5 C7 C8	15	30	45
ICT practicals	A5 A6 A7 A10 A12 C3	7	28	35
Mixed objective/subjective test	B5 B6 B7 B8 C6	2	9	11
Personalized attention		5	0	5

(\*The information in the planning table is for guidance only and does not take into account the heterogeneity of the students.

Methodologies	
Methodologies	Description
Introductory activities	O curso comezará cunha sesión expositiva na que se presentará a materia, exporanse con detalle o traballo a desenvolver polos alumnos e os criterios de avaliación e, repasaranse os conceptos básicos das materias de Econometría anteriormente cursadas.
Guest lecture / keynote speech	Docencia expositiva consistente en leccións impartidas polos profesores, nas que se desenvolverá o contido teórico do programa mediante exposición oral complementada por medios audiovisuais.
Workshop	Docencia interactiva dedicada á solución de exercicios nos que se aplican os conceptos teóricos.
ICT practicals	Sesións interactivas dedicadas á presentación e aplicación das ferramentas informáticas relacionadas cos contidos do programa.
Mixed objective/subjective test	Proba escrita para avaliar o grao de aprendizaxe.

Personalized attention	
Methodologies	Description
Workshop ICT practicals Mixed objective/subjective test	A heteroxeneidade dos estudantes, no que se refire á súa formación previa e á súa situación académica, require unha atención personalizada que permita resolver as dúbidas específicas que teñan ao longo do curso. As prácticas a través de TIC, os talleres e as titorías son ferramentas importantes para resolver problemas teóricos e empíricos, tanto a nivel colectivo como individual.

Assessment			
Methodologies	Competencies / Results	Description	Qualification
Workshop	A1 A3 A4 A8 A13 B3 B4 C1 C4 C5 C7 C8	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. Estas actividades computarán na avaliación ata un máximo de 3 puntos sobre 10.	30
Mixed objective/subjective test	B5 B6 B7 B8 C6	Proba escrita para a avaliación da aprendizaxe. Poderá combinar distintos tipos de preguntas de tipo teórico e práctico. Esta proba computará na avaliación ata un máximo de 7 puntos sobre 10.	70

Assessment comments



- 1) Para superar a materia obteranse polo menos 5 puntos, cun mínimo de 2.5 na proba mixta.
  - 2) O sistema de avaliación será aplicado, tal e como se describe no apartado anterior, en todas e cada unha das oportunidades e a todos os alumnos, con independencia da súa situación académica.
  - 3) Os alumnos con dedicación parcial están exentos de asistencia excepto nas datas de realización das probas de avaliación.
  - 4) A cualificación de non presentado corresponde unicamente ao alumnado que participe en actividades de avaliación que teñan unha ponderación inferior ao 20 por cento da cualificación total.
  - 5) Como é preceptivo, as probas de avaliación rexeranse polas "Normas de avaliación, revisión e reclamación das cualificacións dos estudos de grao e mestrado universitario" da UDC.
- Recoméndase prestar especial atención aos artigos 10 (Identificación dos estudantes) e 14 (Comisión de fraude e responsabilidades disciplinarias).

### Sources of information

<b>Basic</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>- Arranz, M. (2017). Material para el desarrollo de las clases . Moodle</li> <li>- Carrascal, U., González, Y. y Rodríguez, B. (2000). Análisis econométrico con EViews. RA-MA</li> <li>- Guisán, M.C. (1997). Econometría. McGraw-Hill</li> <li>- Gujarati, D. y Porter, D. (2011). Econometría. McGraw-Hill</li> <li>- Ramil, M.; Rey, c.; Lodeiro, M.; Arranz, M. (2012). Introducción a la Econometría. Noroeste S.L ISBN 13:978-84-92794-64-5</li> </ul>
<b>Complementary</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>- Pena Trapero, J. et al (1999). Cien ejercicios de econometría. Pirámide</li> <li>- Pulido, A. y Pérez, J. (2001). Modelos econométricos. Pirámide</li> <li>- Ramil, M. y Arranz, M. (2001). Modelos de ecuaciones simultáneas. ISBN 84-688-6034-4</li> <li>- Wooldridge, J. M. (2006). Introducción a la econometría. Un enfoque moderno.. THOMSON</li> </ul> <p>É posible que se utilicen outros libros de texto, fontes de datos e material dispoñible na rede. Informarase no curso.</p>

### Recommendations

#### Subjects that it is recommended to have taken before

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

#### Subjects that are recommended to be taken simultaneously

#### Subjects that continue the syllabus

#### Other comments

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



(\*)The teaching guide is the document in which the URV publishes the information about all its courses. It is a public document and cannot be modified. Only in exceptional cases can it be revised by the competent agent or duly revised so that it is in line with current legislation.