



| Guía docente          |  |                    |  |          |
|-----------------------|--|--------------------|--|----------|
| Datos Identificativos |  |                    |  | 2017/18  |
| Asignatura (*)        | Econometría II   | Código             | 611G01027                                |          |
| Titulación            | Grao en Economía   |                    |  |          |
| Descriptorios         |  |                    |  |          |
| Ciclo                 | Periodo  | Curso              | Tipo                                     | Créditos |
| Grado                 | 2º cuatrimestre  | Tercero            | Obligatoria                              | 6        |
| Idioma                | Castellano   |                    |  |          |
| Modalidad docente     | Presencial   |                    |  |          |
| Prerrequisitos        |  |                    |  |          |
| Departamento          | Economía   |                    |  |          |
| Coordinador/a         | Arranz Perez, Matilde  | Correo electrónico | matilde.arranz@udc.es                    |          |
| Profesorado           | Arranz Perez, Matilde<br>Lado González, Eva Mª   | Correo electrónico | matilde.arranz@udc.es<br>eva.lado@udc.es |          |
| Web                   |  |                    |  |          |
| Descripción general   | Esta materia es una ampliación de la Econometría I que analiza diversos temas de gran interés teórico y aplicado para la especificación y estimación de modelos econométricos. |                    |  |          |

| Competencias / Resultados del título |  |
|--------------------------------------|--|
| Código                               | Competencias / Resultados del título   |
| A1                                   | CE1-Contribuir a la buena gestión de la asignación de recursos tanto en el ámbito privado como en el público.  |
| A2                                   | CE2-Identificar y anticipar problemas económicos relevantes en relación con la asignación de recursos en general, tanto en el ámbito privado como en el público.   |
| A3                                   | CE3-Aportar racionalidad al análisis y a la descripción de cualquier aspecto de la realidad económica.   |
| A4                                   | CE4-Evaluar consecuencias de distintas alternativas de acción y seleccionar las mejores, dados los objetivos.  |
| A5                                   | CE5-Emitir informes de asesoramiento sobre situaciones concretas de la economía (internacional, nacional o regional) o de sectores de la misma.  |
| A6                                   | CE6-Redactar proyectos de gestión económica a nivel internacional, nacional o regional. Integrarse en la gestión empresarial.  |
| A7                                   | CE7-Identificar las fuentes de información económica relevante y su contenido.   |
| A8                                   | CE8-Entender las instituciones económicas como resultado y aplicación de representaciones teóricas o formales acerca de cómo funciona la economía.   |
| A9                                   | CE9-Derivar de los datos información relevante imposible de reconocer por no profesionales.  |
| A10                                  | CE10-Usar habitualmente la tecnología de la información y las comunicaciones en todo su desempeño profesional.   |
| A11                                  | CE11-Leer y comunicarse en el ámbito profesional en más de un idioma, en especial en inglés.   |
| A12                                  | CE12-Aplicar al análisis de los problemas criterios profesionales basados en el manejo de instrumentos técnicos.   |
| A13                                  | CE13-Comunicarse con fluidez en su entorno y trabajar en equipo.   |
| B1                                   | CB1 - Que los estudiantes hayan demostrado poseer y comprender conocimientos en un área de estudio que parte de la base de la educación secundaria general, y se suele encontrar a un nivel que, si bien se apoya en libros de texto avanzados, incluye también algunos aspectos que implican conocimientos procedentes de la vanguardia de su campo de estudio. |
| B2                                   | CB2 -Que los estudiantes sepan aplicar sus conocimientos a su trabajo o vocación de una forma profesional y posean las competencias que suelen demostrarse por medio de la elaboración y defensa de argumentos y la resolución de problemas dentro de su área de trabajo   |
| B3                                   | CB3 - Que los estudiantes tengan la capacidad de reunir e interpretar datos relevantes (normalmente dentro de su área de estudio) para emitir juicios que incluyan una reflexión sobre temas relevantes de índole social, científica o ética   |
| B4                                   | CB4 - Que los estudiantes puedan transmitir información, ideas, problemas y soluciones a un público tanto especializado como no especializado  |
| B5                                   | CB5 - Que los estudiantes hayan desarrollado aquellas habilidades de aprendizaje necesarias para emprender estudios posteriores con un alto grado de autonomía   |
| B6                                   | CG1- Que los estudiantes formados se conviertan en profesionales capaces de analizar, reflexionar e intervenir sobre los diferentes elementos que constituyen los sistemas económicos  |



|    |   |
|----|---|
| B7 | CG2 -Que los estudiantes conozcan el funcionamiento y las consecuencias de los sistemas económicos, las distintas alternativas de asignación de recursos, acumulación de riqueza y distribución de la renta y estén en condiciones de contribuir a su buen funcionamiento y mejora. |
| B8 | CG3 - Que los estudiantes sean capaces de identificar y anticipar los problemas económicos relevantes, identificar alternativas de resolución, seleccionar las más adecuadas y evaluar los resultados a los que conduce.  |
| B9 | CG4 -Que los estudiantes respeten los derechos fundamentales y de igualdad entre hombres y mujeres, respetar la promoción de los Derechos Humanos y los principios de igualdad de oportunidades, no discriminación y accesibilidad universal de las personas con discapacidad       |
| C1 | CT1-Expresarse correctamente, tanto de forma oral como escrita, en las lenguas oficiales de la comunidad autónoma.  |
| C3 | Utilizar las herramientas básicas de las tecnologías de la información y las comunicaciones (TIC) necesarias para el ejercicio de su profesión y para el aprendizaje a lo largo de su vida.   |
| C4 | CT2-Desarrollarse para el ejercicio de una ciudadanía abierta, culta, crítica, comprometida, democrática y solidaria, capaz de analizar la realidad, diagnosticar problemas, formular e implantar soluciones basadas en el conocimiento y orientadas al bien común.                 |
| C5 | CT3-Entender la importancia de la cultura emprendedora y conocer los medios al alcance de las personas emprendedoras.   |
| C6 | CT4-Valorar críticamente el conocimiento, la tecnología y la información disponible para resolver los problemas con los que deben enfrentarse.  |
| C7 | CT5-Asumir como profesional y ciudadano la importancia del aprendizaje a lo largo de la vida.   |
| C8 | CT6-Valorar la importancia que tiene la investigación, la innovación y el desarrollo tecnológico en el avance socioeconómico y cultural de la sociedad.   |

| Resultados de aprendizaje  |   |                      |  |
|--|---|----------------------|--|
| Resultados de aprendizaje  | Competencias / Resultados del título                        |                      |  |
| Conocer y comprender las consecuencias que sobre los estimadores del modelo clásico tiene el incumplimiento de algunas de sus hipótesis. | A1<br>A2<br>A3<br>A4<br>A7<br>A8<br>A9<br>A10<br>A12<br>A13 | B1<br>B2<br>B3       | C1<br>C3<br>C4<br>C5<br>C6<br>C7<br>C8 |
| Saber la forma en que un modelo econométrico puede incorporar información cualitativa.   | A1<br>A2<br>A3<br>A4<br>A7<br>A8<br>A9<br>A10<br>A12<br>A13 | B3<br>B4<br>B5<br>B6 | C3<br>C4<br>C5<br>C6<br>C7<br>C8       |



|   |  |                            |  |
|---|--|----------------------------|--|
| Conocer y comprender la forma en que los modelos dinámicos y los de ecuaciones múltiples pueden ser especificados y estimados.              | A1<br>A2<br>A3<br>A4<br>A7<br>A8<br>A9<br>A10<br>A12<br>A13                    | B9                         | C3<br>C4<br>C5<br>C6<br>C7<br>C8       |
| Conocer y comprender la utilidad de los modelos econométricos para analizar las relaciones económicas que se presentan en la economía real. | A1<br>A2<br>A3<br>A4<br>A5<br>A6<br>A7<br>A8<br>A9<br>A10<br>A11<br>A12<br>A13 | B1<br>B3<br>B7<br>B8<br>B9 | C1<br>C3<br>C4<br>C5<br>C6<br>C7<br>C8 |
| Utilizar herramientas informáticas adecuadas para la aplicación de las competencias anteriores.   | A7<br>A9<br>A10  |                            | C3                                     |

| Contenidos   |   |
|--|---|
| Tema   | Subtema   |
| 1) Multicolinealidad                                     | 1.1 Concepto, causas y consecuencias.<br>1.2 Identificación del problema y posibles soluciones.<br>1.3 La selección de regresores.<br>1.4 Error de especificación: omisión de variables relevantes y/o inclusión de variables irrelevantes.             |
| 2) Las variables ficticias en los modelos econométricos. | 2.1. Definición.<br>2.2. Incorporación de las variables ficticias al modelo.<br>2.3. El caso de la estacionalidad.<br>2.4. Inestabilidad muestral paramétrica: contrastes de Chow y de residuos recursivos.   |
| 3) Modelos dinámicos.                                    | 3.1. Modelos de retardos distribuidos.<br>3.2. Modelos autorregresivos.<br>3.3. Estimación de modelos con regresores aleatorios: Variables Instrumentales.  |
| 4) Modelos de ecuaciones simultáneas.                    | 4.1. Los modelos multiecuacionales: introducción.<br>4.2. Modelos de ecuaciones simultáneas: especificación e hipótesis.<br>4.3. Identificación del modelo.<br>4.4. Estimación de mínimos cuadrados bietápicos (MC2E).<br>4.5. El contraste de Hausman. |

**Planificación**



| Metodoloxías / probas     | Competencias / Resultados               | Horas lectivas (presenciales y virtuales) | Horas traballo autónomo | Horas totales |
|---------------------------|---|---|-------------------------|---------------|
| Actividades iniciais      | A2 A7 A9 A11 B1                         | 3   | 0                       | 3             |
| Sesión magistral          | A9 A11 B2 B8 B9                         | 17  | 34                      | 51            |
| Taller                    | A1 A3 A4 A8 A13 B3<br>B4 C1 C4 C5 C7 C8 | 15  | 30                      | 45            |
| Prácticas a través de TIC | A5 A6 A7 A10 A12 C3                     | 7   | 28                      | 35            |
| Prueba mixta              | B5 B6 B7 B8 C6                          | 2   | 9                       | 11            |
| Atención personalizada    |   | 5   | 0                       | 5             |

(\*Los datos que aparecen en la tabla de planificación són de carácter orientativo, considerando la heterogeneidad de los alumnos

| Metodoloxías              |  |
|---------------------------|--|
| Metodoloxías              | Descrición   |
| Actividades iniciais      | El curso comenzará con una sesión expositiva en la que se presentará la materia, se expondrán con detalle el traballo a desarrollar por los alumnos y los criterios de evaluación y, se repasarán los conceptos básicos de las materias de Econometría anteriormente cursadas. |
| Sesión magistral          | Docencia expositiva consistente en lecciones impartidas por los profesores, en las que se desarrollará el contenido teórico del programa mediante exposición oral complementada por medios audiovisuales.  |
| Taller                    | Docencia interactiva dedicada a la solución de ejercicios en los que se aplican los conceptos teóricos.  |
| Prácticas a través de TIC | Sesiones interactivas dedicadas a la presentación y aplicación de las herramientas informáticas relacionadas con los contenidos del programa.  |
| Prueba mixta              | Prueba escrita para evaluar el grado de aprendizaje.   |

| Atención personalizada                              |  |
|---|--|
| Metodoloxías  | Descrición   |
| Taller<br>Prácticas a través de TIC<br>Prueba mixta | La heterogeneidad de los estudiantes, en lo que se refiere a su formación previa y a su situación académica, requiere una atención personalizada que permita resolver las dudas específicas que se les planteen a lo largo del curso. Las prácticas a través de TIC, los talleres y las tutorías son herramientas importantes para resolver problemas teóricos y empíricos, tanto a nivel colectivo como individual. |

| Evaluación   |   |  |              |
|--------------|---|--|--------------|
| Metodoloxías | Competencias / Resultados               | Descrición   | Calificación |
| Taller       | A1 A3 A4 A8 A13 B3<br>B4 C1 C4 C5 C7 C8 | Se trata de la evaluación continua. Los alumnos deberán tener presencia activa en estas clases y deberán resolver y entregar los ejercicios y cuestiones que les sean propuestos y en la forma que les será indicada. Esta actividades computan en la evaluación hasta un máximo de 3 puntos sobre 10. | 30           |
| Prueba mixta | B5 B6 B7 B8 C6                          | Prueba escrita para la evaluación del aprendizaje. Podrá combinar distintos tipos de preguntas de tipo teórico y práctico. Esta prueba computa en la evaluación hasta un máximo de 7 puntos sobre 10.  | 70           |

| Observaciones evaluación |
|--------------------------|
|                          |



- 1) Para superar la asignatura han de obtenerse al menos 5 puntos, con un mínimo de 2.5 en la prueba mixta.
- 2) El sistema de evaluación será aplicado, tal y como se describe en el apartado anterior, en todas y cada una de las oportunidades y a todos los alumnos, con independencia de su situación académica.
- 3) Los alumnos con dedicación parcial están exentos de asistencia excepto en las fechas de realización de las pruebas de evaluación.
- 4) La calificación de no presentado corresponde únicamente al alumnado que participe en actividades de evaluación que tengan una ponderación inferior al 20 por ciento de la calificación total.
- 5) Como es preceptivo, las pruebas de evaluación se regirán por las "Normas de evaluación, revisión y reclamación de las calificaciones de los estudios de grado y master universitario" de la UDC. Se recomienda prestar especial atención a los artículos 10 (Identificación de los estudiantes) y 14 (Comisión de fraude y responsabilidades disciplinarias).

#### Fuentes de información

|                       |  |
|-----------------------|--|
| <b>Básica</b>         | <ul style="list-style-type: none"> <li>- Arranz, M. (2018). Material para o desenvolvemento das 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>Complementaria</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> |

#### Recomendaciones

##### Asignaturas que se recomienda haber cursado previamente

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

##### Asignaturas que se recomienda cursar simultáneamente

##### Asignaturas que continúan el temario

##### Otros comentarios

Es muy importante que los alumnos estén familiarizados con los contenidos de las materias de Introducción a la Econometría y Econometría &nbsp;&nbsp;&nbsp;I.



(\*) La Guía Docente es el documento donde se visualiza la propuesta académica de la UDC. Este documento es público y no se puede modificar, salvo cosas excepcionales bajo la revisión del órgano competente de acuerdo a la normativa vigente que establece el proceso de elaboración de guías