



| Guía Docente          |                                                                                                                                                                                                                                  |                    |                             |           |
|-----------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|-----------------------------|-----------|
| Datos Identificativos |                                                                                                                                                                                                                                  |                    |                             | 2023/24   |
| Asignatura (*)        | Econometría II                                                                                                                                                                                                                   |                    | Código                      | 611G01027 |
| Titulación            |                                                                                                                                                                                                                                  |                    |                             |           |
| Descriptor            |                                                                                                                                                                                                                                  |                    |                             |           |
| Ciclo                 | Período                                                                                                                                                                                                                          | Curso              | Tipo                        | Créditos  |
| Grao                  | 2º cuatrimestre                                                                                                                                                                                                                  | Terceiro           | Obrigatoria                 | 6         |
| Idioma                | CastelánGalego                                                                                                                                                                                                                   |                    |                             |           |
| Modalidade docente    | Presencial                                                                                                                                                                                                                       |                    |                             |           |
| Prerrequisitos        |                                                                                                                                                                                                                                  |                    |                             |           |
| Departamento          | Economía                                                                                                                                                                                                                         |                    |                             |           |
| Coordinación          | Lado González, Eva Mª                                                                                                                                                                                                            | Correo electrónico | eva.lado@udc.es             |           |
| Profesorado           | Garcia-Carro Peña, Beatriz                                                                                                                                                                                                       | Correo electrónico | beatriz.garcia-carro@udc.es |           |
|                       | Lado González, Eva Mª                                                                                                                                                                                                            |                    | eva.lado@udc.es             |           |
| Web                   |                                                                                                                                                                                                                                  |                    |                             |           |
| Descrición xeral      | Esta materia é unha ampliación dos contidos da Econometría I impartida no primeiro cuatrimestre. Nela analízanse diversos temas de gran interese teórico e aplicado para a especificación e estimación de modelos econométricos. |                    |                             |           |

| Competencias do título |                        |
|------------------------|------------------------|
| Código                 | Competencias do título |

| Resultados da aprendizaxe                                                                                                                               |     |                        |    |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|------------------------|----|
| Resultados de aprendizaxe                                                                                                                               |     | Competencias do título |    |
| Coñecer e comprender as consecuencias que sobre os estimadores MCO dos coeficientes do modelo clásico ten o incumprimento dalgunhas das súas hipóteses. | A1  | B1                     | C1 |
|                                                                                                                                                         | A2  | B2                     | C3 |
|                                                                                                                                                         | A3  | B3                     | C4 |
|                                                                                                                                                         | A4  |                        | C5 |
|                                                                                                                                                         | A7  |                        | C6 |
|                                                                                                                                                         | A8  |                        | C7 |
|                                                                                                                                                         | A9  |                        | C8 |
|                                                                                                                                                         | A10 |                        |    |
|                                                                                                                                                         | A12 |                        |    |
|                                                                                                                                                         | A13 |                        |    |
| Saber a forma en que un modelo econométrico pode incorporar información cualitativa.                                                                    | A1  | B3                     | C3 |
|                                                                                                                                                         | A2  | B4                     | C4 |
|                                                                                                                                                         | A3  | B5                     | C5 |
|                                                                                                                                                         | A4  | B6                     | 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  | B9 | C3 |
|                                                                                                                                     | A2  |    | C4 |
|                                                                                                                                     | A3  |    | C5 |
|                                                                                                                                     | A4  |    | C6 |
|                                                                                                                                     | A7  |    | C7 |
|                                                                                                                                     | A8  |    | C8 |
|                                                                                                                                     | A9  |    |    |
|                                                                                                                                     | A10 |    |    |
|                                                                                                                                     | A12 |    |    |
|                                                                                                                                     | A13 |    |    |
|                                                                                                                                     |     |    |    |
|                                                                                                                                     |     |    |    |
|                                                                                                                                     |     |    |    |
| Coñecer e comprender a utilidade dos modelos econométricos para analizar as relacións económicas que se presentan na economía real. | A1  | B1 | C1 |
|                                                                                                                                     | A2  | B3 | C3 |
|                                                                                                                                     | A3  | B7 | C4 |
|                                                                                                                                     | A4  | B8 | C5 |
|                                                                                                                                     | A5  | B9 | C6 |
|                                                                                                                                     | A6  |    | C7 |
|                                                                                                                                     | A7  |    | C8 |
|                                                                                                                                     | A8  |    |    |
|                                                                                                                                     | A9  |    |    |
|                                                                                                                                     | A10 |    |    |
|                                                                                                                                     | A11 |    |    |
|                                                                                                                                     | A12 |    |    |
|                                                                                                                                     | A13 |    |    |
| Utilizar ferramentas informáticas adecuadas para a aplicación das competencias anteriores.                                          | A7  |    | C2 |
|                                                                                                                                     | A9  |    | C3 |
|                                                                                                                                     | A10 |    |    |

| Contidos                                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Temas                                                | Subtemas                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 1) O modelo de regresión lineal xeneralizado (MRLX)  | 1.1. Hipóteses do modelo. Consecuencias da estimación MCO deste modelo.<br>1.2. Os estimadores de mínimos cadrados xeneralizados (EMCX). Obtención.<br>1.3. Heterocedasticidade: estrutura, causas, contrastes, estimación e predición.<br>1.4. Autocorrelación: estrutura, causas, contrastes, estimación e predición. |
| 2) As variables ficticias nos modelos econométricos. | 2.1. Definición e incorporación ao modelo.<br>2.2. Contrastes de estabilidade da mostra.                                                                                                                                                                                                                                |
| 3) Modelos de ecuacións simultáneas.                 | 3.1. Introducción. Expresión do modelo.<br>3.2. Hipóteses que o definen.<br>3.3. Propiedades dos estimadores MCO. A estimación de variables instrumentais (VI).<br>3.4. A estimación de mínimos cadrados en dúas etapas (MC2E).                                                                                         |

| Planificación         |                                         |                   |                                           |              |
|-----------------------|-----------------------------------------|-------------------|-------------------------------------------|--------------|
| Metodoloxías / probas | Competencias                            | Horas presenciais | Horas non presenciais / traballo autónomo | Horas totais |
| Actividades iniciais  | A2 A7 A9 A11 B1                         | 3                 | 0                                         | 3            |
| Sesión maxistral      | A9 A11 B2 B8 B9                         | 17                | 34                                        | 51           |
| Obradoiro             | 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 C2<br>C3 | 7 | 28 | 35 |
| Proba obxectiva           | B5 B6 B7 B8 C6            | 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 as actividades a desenvolver polos alumnos e os criterios de avaliación e, finalmente, 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. Inclúiranse exemplos e exercicios que permitan amosar a funcionalidade e limitacións dos métodos expostos. |
| Obradoiro                 | Cada taller é unha sesión interactiva na que se realizan aplicacións, exercicios e problemas que permiten aos alumnos comprender os fundamentos teóricos da materia e aprender a valorar, dende un punto de vista crítico, os resultados obtidos.                                                        |
| Prácticas a través de TIC | Trátase de sesións interactivas dedicadas á aprendizaxe das ferramentas informáticas apropiadas para efectuar aplicacións empíricas dos métodos expostos nas sesións teóricas.                                                                                                                           |
| Proba obxectiva           | Proba escrita para avaliar o grao de aprendizaxe.                                                                                                                                                                                                                                                        |

| Atención personalizada                                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|-----------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Metodoloxías                                              | Descrición                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| Obradoiro<br>Prácticas a través de TIC<br>Proba obxectiva | <p>É o tempo que o profesor reserva para atender e resolver dúbidas ao alumnado, ben sexa de forma individual ou en pequenos grupos. A atención prestarase nas horas de clase, nas horas prácticas a través de TIC e no horario semanal de tutorías.</p> <p>A atención personalizada para o alumnado con recoñecemento de dedicación a tempo parcial e dispensa académica de exención de asistencia prestarase principalmente no horario semanal de tutorías dos profesores.</p> <p>As TGR impartiranse de maneira presencial e prevese que a súa programación teña lugar ao redor das semanas 10 e 13 do cuadrimestre.</p> |

| Avaliación      |                                         |                                                                                                                                                                                                                                                                                        |               |
|-----------------|-----------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|
| Metodoloxías    | Competencias                            | Descrición                                                                                                                                                                                                                                                                             | Cualificación |
| Obradoiro       | A1 A3 A4 A8 A13 B3<br>B4 C1 C4 C5 C7 C8 | Recoméndase a presenza activa dos alumnos nestas clases, nas que deberán resolver e entregar os controis, problemas, 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            |
| Proba obxectiva | 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            |

| Observacións avaliación |
|-------------------------|
|-------------------------|



**A) NORMATIVA DE AVALIACIÓN**

**1. Condicións de avaliación**

**1.1 Normas para a realización das probas de avaliación presenciais** Seguindo a normativa aprobada pola Xunta da Facultade de Economía e Empresa, está prohibido acceder á aula na que a se celebre a proba con calquera dispositivo que permita a comunicación co exterior e/ou o almacenamento de información, incluíndo apuntamentos da materia ou similares. Se unha persoa é vista cun dispositivo deste tipo ao seu alcance durante a proba, supoñerase que o emprega con ánimo de fraude e aplicarase a normativa correspondente. As persoas que traian dispositivos deste tipo o día da proba ?incluídos teléfonos móbiles ou reloxos intelixentes- e non teñan onde deixalos, deberán depositalos na entrada da aula antes do comezo da proba. O profesorado non se fai responsable da súa posible perda ou extravío.

**1.2 Normas para a realización das probas de avaliación controladas a través de Teams** As persoas que vaian realizar a proba deben estar conectadas a Teams en todo momento, salvo que se especifique o contrario de maneira expresa nas instrucións desa proba concreta. Se unha persoa se desconecta de Teams durante a realización da proba ou sae do campo de visión da cámara durante a súa realización, a proba considerarase non entregada. Cada estudante deberá ter a cámara web activada en todo momento; a desconexión da cámara considerarase equivalente a unha desconexión de Teams, e supoñerá que a proba se considere non entregada. O profesorado gravará a proba como garantía da identificación do estudantado e da realización do proceso de avaliación esixido pola Lei Orgánica de Universidades. É responsabilidade de cada estudante configurar o seu espazo para evitar a vulneración da intimidade ou dos datos persoais seus ou de terceiras persoas. En todo o relativo á gravación destas probas aplicarase estritamente a normativa da universidade. Salvo que se indique o contrario, aplicaranse as mesmas normas que nunha proba presencial: non se poderá acceder a ningún dispositivo que permita a comunicación con terceiros y/ou o almacenamento de información, incluíndo apuntamentos da materia ou similares, teléfonos móbiles, reloxos intelixentes, tabletas, computadores, etc. Se unha persoa é vista cun dispositivo deste tipo ao seu alcance durante a proba, supoñerase que o emprega con ánimo de fraude e aplicarase a correspondente normativa.

**2. Identificación do estudante** O estudante deberá acreditar a súa identidade de acordo coa normativa vixente. Para iso o profesorado poderá requirir en calquera momento a identificación do estudante, quen deberá acreditala mediante a tarxeta de estudante da UDC, o documento nacional de identidade, ou un documento identificativo que a xuízo do profesorado sexa equivalente aos anteriores.

**3. Procedemento de actuación ante a realización fraudulenta dunha actividade que computa na avaliación** A realización fraudulenta das probas ou actividades de avaliación, unha vez comprobada, implicará directamente a cualificación de suspenso na convocatoria en que se cometa: o/a estudante será cualificado con ?suspenso? (nota numérica 0) na convocatoria correspondente do curso académico, tanto se a comisión da falta se produce na primeira oportunidade como na segunda. Para isto, procederase a modificar a súa cualificación na acta de primeira oportunidade, se fose necesario.

**B) TIPOS DE CALIFICACIÓN**

**1. Cualificación de non presentado** Seguindo a normativa aprobada pola Xunta da Facultade de Economía e Empresa, só serán cualificadas con Non Presentado as persoas que se presentaron a actividades que en conxunto supoñan menos do 20% da nota final desa oportunidade.

**2. Estudantes con recoñecemento de dedicación a tempo parcial e dispensa académica de exención de asistencia** Aplicaráselle as mesmas normas de avaliación que ao estudantado matriculado a tempo completo, tanto na primeira oportunidade como na segunda. As persoas con recoñecemento de dedicación a tempo parcial están exentas da asistencia a clase, pero teñen a mesma obrigación de acudir a calquera tipo de proba de avaliación presencial que o estudantado a tempo completo.

**C) OPORTUNIDADES DE AVALIACIÓN**

**1. Primeira oportunidade** A avaliación da materia constará dun ou varios talleres e dunha proba obxectiva: os talleres terán unha cualificación máxima do 30% correspondendo o restante 70% da materia a unha proba obxectiva, que se realizará na data establecida no calendario académico oficial, na que se avaliarán os contidos da materia (temas 1, 2 e 3) sendo necesario obter un mínimo de 2.5 puntos sobre 7 nesta proba. Por tanto, para aprobar a materia é necesario alcanzar un mínimo de 2.5 puntos sobre 7 na proba obxectiva de primeira oportunidade e obter polo menos 5 puntos na suma das cualificacións dos talleres e da proba obxectiva. Os alumnos que non alcanzasen a nota mínima na proba obxectiva (2.5 puntos sobre 7) e que no cómputo global da avaliación obtivesen unha puntuación igual ou superior a 5 puntos, non terán aprobada a materia e figurarán en actas cunha nota de 4.5.

**2. Segunda oportunidade** O exame de segunda oportunidade realizarase o día e hora fixados pola Facultade de Economía e Empresa para o exame oficial da segunda oportunidade. Os criterios de avaliación na segunda oportunidade serán os mesmos que os aplicados na primeira oportunidade, por tanto a proba obxectiva seguirá valorándose co 70% da cualificación total (cunha nota mínima de 2.5 puntos sobre 7). Para obter o 100% da cualificación nesta segunda oportunidade, o profesorado indicará a proba que será necesaria para recuperar o 30% de avaliación continua. Os estudantes que queiran optar á recuperación do devandito 30% de avaliación deberán ter en conta que a nota definitiva da avaliación continua será a que se obteña nesta segunda oportunidade, perdéndose a puntuación obtida durante a primeira. Para superar a materia a nota final deberá ser igual ou superior a 5 puntos. Os alumnos que non alcanzasen a nota mínima na proba obxectiva (2.5 puntos sobre 7) e que no cómputo global da avaliación obtivesen unha puntuación igual ou superior a 5 puntos, non terán aprobada a materia e figurarán en actas cunha nota de 4.5.

**3. Convocatoria adiantada** A avaliación correspondente á oportunidade adiantada desenvolverase a través dunha única proba que se celebrará na data e hora establecidas polo centro. Dita proba valorarase cun máximo de 10 puntos e terá como base o temario completo que se describe no apartado "Contidos" da guía do curso académico vixente. Para aprobar a materia será necesario obter un mínimo de 5 puntos nesta proba obxectiva. Estas condicións de avaliación son específicas para a oportunidade adiantada e só se aplicarán neste suposto.



## Fontes de información

|                                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>Bibliografía básica</b>         | <ul style="list-style-type: none"><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>- Fernández Gallastegui, Alonso (2004). Econometría. Pearson. Prentice Hall</li><li>- Ramil, M., Rey, C., Lodeiro, M., Arranz, M. (2013). Introducción a la Econometría. Noroeste S.L ISBN 13:978-84-92794-64-5</li></ul>                                                                                                                                                                                                                                     |
| <b>Bibliografía 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, Jeffrey (2015). Introducción a la econometría. Un enfoque moderno.. Cengage Learning</li></ul> <p>A medida que se avanza no coñecemento das técnicas econométricas é recomendable a lectura de artigos enfocados a resolver problemas reais da economía. Poderanse utilizar, ademais, outros libros de texto así como distintas fontes de datos e materiais dispoñibles na rede que se detallarán ao longo do curso.</p> |

## Recomendacións

### Materias que se recomenda ter cursado previamente

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

### Materias que se recomenda cursar simultaneamente

### Materias que continúan o temario

## Observacións

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

### 2) OUTRAS CONSIDERACIÓNS

- A entrega dos traballos documentais que se realicen nesta materia solicitarase de modo virtual, en formato dixital e sen necesidade de imprimilos.
- Débese ter en conta a importancia dos principios éticos relacionados cos valores de sustentabilidade nos comportamentos persoais e profesionais.- Valorarase positivamente a implicación do alumnado nas actividades realizadas pola Facultade de Economía e Empresa, como a asistencia a conferencias, congresos, participación no Plan de Acción Titorial (PAT), colaboración co proxecto Green Campus, etc.
- Traballarase para identificar e modificar prexuízos e actitudes sexistas e influirase na contorna para modificalos e fomentar valores de respecto e igualdade. - Facilitarase a plena integración do alumnado que por razóns físicas, sensoriais, psíquicas ou socioculturais, experimenten dificultades a un acceso adecuado, igualitario e proveitoso á vida universitaria.



(\*)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