



| Guia docente          |                                                                                                                                                                                |                    |                       |           |
|-----------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------|
| Datos Identificativos |                                                                                                                                                                                |                    |                       | 2019/20   |
| Asignatura (*)        | Econometría II                                                                                                                                                                 |                    | Código                | 611G01027 |
| Titulación            | Grao en Economía                                                                                                                                                               |                    |                       |           |
| Descriptor            |                                                                                                                                                                                |                    |                       |           |
| 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                                                                                                                                                          | Correo electrónico | matilde.arranz@udc.es |           |
|                       | Lado González, Eva Mª                                                                                                                                                          |                    | 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 del título |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|-------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Código                  | Competencias 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 del título |    |    |
| Conocer y comprender las consecuencias que sobre los estimadores del modelo clásico tiene el incumplimiento de algunas de sus hipótesis. | A1                      | B1 | C1 |
|                                                                                                                                          | A2                      | B2 | C3 |
|                                                                                                                                          | A3                      | B3 | C4 |
|                                                                                                                                          | A4                      |    | C5 |
|                                                                                                                                          | A7                      |    | C6 |
|                                                                                                                                          | A8                      |    | C7 |
|                                                                                                                                          | A9                      |    | C8 |
|                                                                                                                                          | A10                     |    |    |
|                                                                                                                                          | A12                     |    |    |
|                                                                                                                                          | A13                     |    |    |
| Saber la forma en que un modelo econométrico puede incorporar información cualitativa.                                                   | A1                      | B3 | C3 |
|                                                                                                                                          | A2                      | B4 | C4 |
|                                                                                                                                          | A3                      | B5 | C5 |
|                                                                                                                                          | A4                      | B6 | C6 |
|                                                                                                                                          | A7                      |    | C7 |
|                                                                                                                                          | A8                      |    | C8 |
|                                                                                                                                          | A9                      |    |    |
|                                                                                                                                          | A10                     |    |    |
|                                                                                                                                          | A12                     |    |    |
|                                                                                                                                          | A13                     |    |    |



|                                                                                                                                             |                                                                                |                            |                                        |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------------------------|
| 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) el modelo de regresión lineal generalizado (MRLG).    | 1.1 Hipótesis del modelo. consecuencias de la estimación MCO de este modelo.<br>1.2 Los estimadores de mínimos cuadrados generalizados (EMCG). Obtención.<br>1.3 Heterocedasticidad: estructura, causas, contrastes, estimación y predicción.<br>1.4 Autocorrelación: estructura, causas, contrastes, estimación y predicción. |
| 2) Las variables ficticias en los modelos econométricos. | 2.1. Definición e incorporación al modelo.<br>2.2. Contrastes de estabilidad muestral.                                                                                                                                                                                                                                         |
| 3) Modelos de ecuaciones simultáneas.                    | 3.1. Introducción. Expresión del modelo.<br>3.2. Hipótesis que lo definen.<br>3.3. Propiedades de los estimadores MCO. La estimación de variables instrumentales (VI).<br>3.4. La estimación de mínimos cuadrados en dos etapas (MC2E).                                                                                        |

| Planificación          |                 |                    |                                          |               |
|------------------------|-----------------|--------------------|------------------------------------------|---------------|
| Metodologías / pruebas | Competencias    | Horas presenciales | Horas no presenciales / trabajo autónomo | Horas totales |
| Actividades iniciales  | 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

| Metodologías              |                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Metodologías              | Descripción                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| Actividades iniciales     | El curso comenzará con una sesión expositiva en la que se presentará la materia, se expondrán con detalle el trabajo 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                              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|-----------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Metodologías                                        | Descripción                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 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   |                                         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |              |
|--------------|-----------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------|
| Metodologías | Competencias                            | Descripción                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 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. (2019). 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>- 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> <li>- (). .</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, Jeffrey (2015). Introducción a la econometría. Un enfoque moderno.. Cengage Learning</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;l.

(\*) 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