

**FICHA IDENTIFICATIVA****DATOS DE LA ASIGNATURA**

Código: 36112
Nombre: Econometría II
Ciclo: Grado
Créditos ECTS: 6
Curso académico: 2025-26

TITULACIONES

Titulación	Centro	Curso	Periodo
1316 - Grado en Economía	Facultat d'Economia	3	Segundo cuatrimestre

MATERIAS

Titulación	Materia	Carácter
1316 - Grado en Economía	Econometría	OBLIGATORIA

COORDINACIÓN

SERRANO DOMINGO GUADALUPE

RESUMEN

La asignatura Econometría II tiene carácter obligatorio y semestral, con una carga lectiva total de 6 créditos ECTS (150 horas), impartándose en el tercer curso del Grado en Economía. La materia Econometría, comprende las asignaturas Econometría I y Econometría II, impartándose la primera en el primer semestre del curso y la segunda en el segundo semestre del curso. El objetivo de la materia es proporcionar a los estudiantes del Grado en Económicas los conocimientos básicos de la disciplina de Econometría, que aúna conceptos provenientes de la Teoría Económica, de las Matemáticas y la Estadística, y cuyo fin es proveer al economista de los instrumentos adecuados para abordar el análisis de la realidad económica y su evolución. Es por lo tanto una materia de gran nivel formativo, práctico y teórico que junto con la utilización de programas informáticos proporciona al alumno una visión integral de los instrumentos de análisis cuantitativo de la realidad económica y de predicción.

Los contenidos de la asignatura Econometría II se centran en la ampliación de conocimientos adquiridos en la Econometría I y en el estudio de algunos problemas econométricos especiales. Una primera parte del curso se dedica al estudio de la endogeneidad y de algunos de los métodos clásicos y actuales para la identificación de relaciones causales. Se presentan además los datos de panel (estimación de efectos fijos de unidad y de tiempo), algunos de los métodos de evaluación de políticas (análisis causal) más utilizados



actualmente, y la estimación de modelos con variables dependientes binarias (modelos Logit y Probit). La segunda parte se dedica al estudio de las series temporales (modelos dinámicos, estacionariedad y modelos ARIMA para predicción). Los estudiantes deberán utilizar conocimientos previos provenientes de diferentes materias que han cursado previamente: álgebra matricial, cálculo, estadística y econometría.

Así, esta asignatura proporciona un enfoque integrador y cuantitativo que permite el análisis de problemas económicos reales a partir de información estadística o bien permite la predicción. Ello dota al alumno de los instrumentos necesarios para el desarrollo de su actividad laboral futura, tanto si se centra en el asesoramiento y consultoría en el ámbito empresarial y privado, como si desarrolla su labor como economista en empresas e instituciones públicas.

CONOCIMIENTOS PREVIOS

RELACIÓN CON OTRAS ASIGNATURAS DE LA MISMA TITULACIÓN

No se han especificado restricciones de matrícula con otras asignaturas del plan de estudios.

OTROS TIPOS DE REQUISITOS

No se han especificado restricciones de matrícula con otras asignaturas del plan de estudios. Es recomendable que el alumno recuerde y maneje algunos conocimientos provenientes de las Matemáticas, Estadística, Teoría Económica y de la Econometría I.

COMPETENCIAS / RESULTADOS DE APRENDIZAJE

-

Aplicar los principios del análisis económico (decisión racional) al diagnóstico y resolución de problemas.

Capacidad de aprendizaje autónomo.

Capacidad de manejar las tecnologías de la información.

Capacidad para la búsqueda y análisis de información.

Capacidad para la toma de decisiones aplicando los conocimientos a la práctica.

Comprender y aplicar el método científico, consistente en formular hipótesis, deducir resultados comprobables y contrastarlos con la evidencia empírica y experimental.

Conocimiento y comprensión de las herramientas básicas de naturaleza cuantitativa para el análisis, diagnóstico y prospección económica, como lo son las matemáticas, la estadística y la econometría.

Ser capaz de elaborar y defender un informe económico.



DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS

1. Sesgo/Inconsistencia del estimador MCO

- 1.1 Incumplimiento de la esperanza condicional nula del error. Causas: variables omitidas, errores de medida, simultaneidad.
- 1.2 El caso de SIMULTANEIDAD en las relaciones económicas, restricciones de exclusión e identificación.
- 1.3 Estimación de variables instrumentales y MC2E (2SLS).
- 1.4 Propiedades de la estimación por VI.
- 1.5 Contrastes de endogeneidad, debilidad de instrumentos y validez de instrumentos.

2. Datos de panel

- 2.1 Estructura y ventajas de los datos de panel.
- 2.2 Efectos fijos de tiempo y de individuo (two-way fixed effects, TWFE)
- 2.3 Efectos fijos como solución a sesgos por heterogeneidad inobservable.

3. El enfoque del contrafactual para identificar relaciones causales

- 3.1 Intuición: ¿qué hubiera pasado si...? Paralelismo con los datos experimentales.
- 3.2 Presentación de algunos estimadores de diseño: estimadores matching, estimación diff-in-diff, la regresión en discontinuidad y el método de control sintético.
- 3.3 Condiciones necesarias en cada caso para validar el método.

4. Variables dependientes cualitativas

- 4.1 Modelos de elección discreta.
- 4.2 Modelo Lineal de Probabilidad, Logit y Probit.
- 4.3 Estimación por Máxima Verosimilitud.
- 4.4 Interpretación de coeficientes.

5. Modelos dinámicos

- 5.1 Modelos de retardos distribuidos.
- 5.2 Multiplicadores de corto y largo plazo.
- 5.3 Estimación con y sin autocorrelación de los errores. Variables Instrumentales.
- 5.4 Contrastes de autocorrelación de los errores.

6. Series temporales: predicción con modelos ARIMA

- 6.1 Enfoques para la predicción económica.
- 6.2 Procesos ARMA y ARIMA.
- 6.3 Función de autocorrelación simple y Función de Autocorrelación Parcial.



6.4 Identificación, estimación, validación y predicción.

VOLUMEN DE TRABAJO (HORAS)**ACTIVIDADES PRESENCIALES**

Actividad	Horas
Teoría	30,00
Prácticas en aula	30,00
Total horas	60,00

ACTIVIDADES NO PRESENCIALES

Actividad	Horas
Asistencia a otras actividades	0,00
Elaboración de trabajos individuales o en grupo	10,00
Estudio y trabajo autónomo	50,00
Preparación de clases	30,00
Preparación de actividades de evaluación	0,00
Resolución de casos prácticos	0,00
Total horas	90,00

METODOLOGÍA DOCENTE

- En las clases teóricas se combina la exposición de la materia a tratar en cada sesión, apoyada con la proyección de resúmenes y con la resolución de ejercicios y casos prácticos propuestos por el profesor, para la mejor comprensión de la teoría.
- En las clases prácticas se resolverán ejercicios en la pizarra, por parte del profesor y del alumno y se realizarán ejercicios con el ordenador tanto de forma individual como en grupos.
- Además de consultar la bibliografía de referencia, el alumno dispondrá del material de trabajo elaborado para cada tema, tanto teórico como práctico, que se publicará en el aula virtual con la debida antelación.

Los trabajos prácticos irán orientados al aprendizaje de la elaboración de un informe que explique los pasos realizados durante el análisis de un problema económico: planteamiento y motivación del problema y de su análisis, búsqueda de un modelo económico sencillo que relacione las variables relevantes del problema y búsqueda de información estadística sobre dichas variables. Se presentarán algunas de las bases de datos económicos tanto de carácter nacional como internacional (bases de datos electrónicas disponibles en la página web de la OCDE o bases de datos de organismo nacionales o internacionales como en Instituto Nacional de Estadística (www.ine.es) Eurostat (<http://ec.europa.eu/eurostat>) , Naciones



Unidas (<http://unstats.un.org/unsd/default.htm>) o las Penn World Tables (<https://www.rug.nl/ggdc/productivity/pwt/>).

oductivity/pwt/).

EVALUACIÓN

La asignatura utiliza el siguiente procedimiento de evaluación de competencias:

- **Prueba de síntesis:** Prueba escrita, consistente en un examen que constará de cuestiones teóricas y/o teórico-prácticas y/o de problemas sobre todo el contenido de la asignatura que figura en la Guía Académica. Esta prueba conformará el 70% de la nota del estudiante.
- **Evaluación continua del estudiante a partir de** la elaboración de informes breves, resolución de ejercicios o respuesta de cuestionarios sobre los contenidos que figuran en la Guía a lo largo del curso. Dicha evaluación se organizará en torno a la realización y presentación de un máximo de **3 entregas** que se solicitarán al alumno a lo largo del curso. Esta evaluación continua de carácter no recuperable conformará el 30% de la nota del estudiante.

Nota Final: la nota final será la **suma ponderada** de la prueba de síntesis y de la evaluación continua (no recuperable, por lo que no se puede hacer y o entregar para la segunda convocatoria del examen). Para sumar la evaluación continua es imprescindible superar la prueba de síntesis. En caso contrario la nota final de la asignatura no podrá superar un máximo de 4.5 puntos.

Esta evaluación se aplicará tanto en la primera como en la segunda convocatoria de la asignatura.

El alumno bajo sospecha de intento de copia, plagio o suplantación en la realización de las entregas o del examen tendrá una nota final de cero.

La normativa oficial del centro respecto a evaluación y calificación de asignaturas puede consultarse en el siguiente enlace:

https://www.uv.es/graus/normatives/2017_108_Reglament_avaluacio_qualificacio.pdf



BIBLIOGRAFÍA

- Wooldridge, J (2016). Introducción a la econometría, 5ª Edición. Cengage Learning
- English Version: Wooldridge, J (2020). Introductory Econometrics A Modern Approach. 7th Edition. Cengage Learning
- Stock J.H. y Watson M.M. (2019) Introduction to Econometrics, 4th Edition. Pearson.
- Greene, W. (2018). Econometric analysis, 8th Edition. Pearson.
- Matilla M., Pérez P. y Sanz B.(2017) Econometría y Predicción, 2ª Ed. McGraw Hill.
- Gujarati, D. (2014) Econometrics by example, 2nd Edition. Palgrave MacMillan
- Gujarati, D. y Porter D.C. (2010) Econometría, 5ª Edición. McGraw-Hill.
- Cabrer B., Sancho a. y Serrano G. (2001): Microeconometría y decisión. Pirámide.
- Heiss, F. (2016) Using R for Introductory Econometrics. Using the Independent Publishing Platform CreateSpace.