

**FITXA IDENTIFICATIVA****DADES DE L'ASSIGNATURA**

**Codi:** 36112  
**Nom:** Econometria II  
**Cicle:** Grau  
**Crèdits ECTS:** 6  
**Curs acadèmic:** 2025-26

**TITULACIONS**

Titulació	Centre	Curs	Període
1316 - Grau Economia	Facultat d'Economia	3	Segon quadrimestre

**MATÈRIES**

Titulació	Matèria	Caràcter
1316 - Grau Economia	Econometria	OBLIGATÒRIA

**COORDINACIÓ**

SERRANO DOMINGO GUADALUPE

**RESUM**

L'assignatura Econometria II té caràcter obligatori i semestral, amb una càrrega lectiva total de 6 crèdits ECTS (150 hores), impartint-se en el tercer curs del Grau en Economia. La matèria Econometria, comprèn les assignatures Econometria I i Econometria II, impartint-se la primera en el primer semestre del curs i la segona en el segon semestre del curs. L'objectiu de la matèria és proporcionar als estudiants del Grau en Econòmiques els coneixements bàsics de la disciplina d'Econometria, que combina conceptes provinents de la Teoria Econòmica, de les Matemàtiques i l'Estadística, i la fi de la qual és proveir a l'economista dels instruments adequats per a abordar l'anàlisi de la realitat econòmica i la seva evolució. És per tant una matèria de gran nivell formatiu, pràctic i teòric que juntament amb la utilització de programes informàtics proporciona a l'alumne una visió integral dels instruments d'anàlisi quantitativa de la realitat econòmica i de predicció.

Els continguts de l'assignatura Econometria II se centren en l'ampliació de coneixements adquirits en la Econometria I i en l'estudi d'alguns problemes econòmics especials. Una primera part del curs es dedica a l'estudi de l'endogeneïtat i d'alguns dels mètodes clàssics i actuals per la identificació de relacions causals. Es presenten, a més, les dades de panell (estimació d'efectes fixes d'unitat i de temps), alguns dels mètodes d'avaluació de polítiques (anàlisi causal) més utilitzats actualment, i l'estimació de models amb variable dependent binària (models Logit i Probit). La segona part es dedica a l'estudi de les sèries temporals (models dinàmics, estacionarietat i models ARIMA per a predicció). Els estudiants hauran d'utilitzar coneixements previs provinents de diferents matèries que han cursat prèviament: àlgebra



matricial, càlcul, estadística i econometria.

Així, aquesta assignatura genera el valor afegit de proporciona un enfocament integrador i quantitatiu que permet l'anàlisi de problemes econòmics reals a partir d'informació estadística o bé permet la predicció de la evolució d'una economia. Això dota a l'alumne dels instruments necessaris per al desenvolupament de la seva activitat laboral futura, tant si se centra en l'assessorament i consultoria en l'àmbit empresarial i privat, com si desenvolupa la seva labor com a economista en empreses i institucions públiques.

## CONEXIMENTS PREVIS

### RELACIÓ AMB ALTRES ASSIGNATURES DE LA MATEIXA TITULACIÓ

No s'ha especificat restriccions de matrícula amb altres assignatures del pla d'estudis.

### ALTRES TIPUS DE REQUISITS

No s'han especificat restriccions de matrícula amb altres assignatures del pla d'estudis. És recomanable que l'alumne recordi i manegi alguns coneixements provinents de les Matemàtiques, Estadística, Teoria Econòmica i de l'Econometria I.

## COMPETÈNCIES / RESULTATS D' APRENTATGE

-

Aplicar els principis de l'anàlisi econòmica (decisió racional) al diagnòstic i a la resolució de problemes.

Capacitat d'aprenentatge autònom.

Capacitat per a la cerca i l'anàlisi d'informació.

Capacitat per a la presa de decisions aplicant els coneixements a la pràctica.

Capacitat per manejar les tecnologies de la informació.

Comprendre i aplicar el mètode científic, consistent a formular hipòtesis, deduir resultats comprovables i confrontar-los amb l'evidència empírica i experimental.

Coneixement i comprensió de les eines bàsiques de naturalesa quantitativa per a l'anàlisi, el diagnòstic i la prospecció econòmica, com ara les matemàtiques, l'estadística i l'econometria.

Ser capaç d'elaborar i defensar un informe econòmic.



## DESCRIPCIÓ DE CONTINGUTS

### 1. Inconsistència de MCO.

- 1.1 Incompliment de l'esperança condicional nul·la de l'error. Causes: variables omeses, errors de mesura, simultaneïtat.
- 1.2 SIMULTANÈITAT en les relacions econòmiques, restriccions d'exclusió i identificació.
- 1.3 Estimació de variables instrumentals i MC2E (2SLS).
- 1.4 Propietats de l'estimació per VI.
- 1.5 Contrasts d'endogeneïtat, debilitat d'instruments i validesa d'instruments.

### 2. Dades de panell

- 2.1 Estructura i avantatges de les dades de panell.
- 2.2 Efectes fixos de temps i d'individu (two-way fixed effects, TWFE)  
Efectes fixos com a solució a biaixos per heterogeneïtat inobservable.

### 3. L'enfocament del contrafactual per a identificar relacions causals

- 3.1 Intuïció: què hauria passat si? Paral·lelisme amb les dades experimentals.
- 3.2 Presentació d'alguns estimadors de disseny: estimadors matching, estimació diff-in-diff, la regressió en discontinuïtat i el mètode de control sintètic.
- 3.3 Condicions necessàries en cada cas per a validar el mètode.

### 4. Variables dependents qualitatives

- 4.1 Models d'elecció discreta.
- 4.2 Model Lineal de Probabilitat, Logit i Probit.
- 4.3 Estimació per Màxima Versemblança.
- 4.4 Interpretació de coeficients.

### 5. Models dinàmics

- 5.1 Models de retards distribuïts.
- 5.2 Multiplicadors de curt i llarg termini.
- 5.3 Estimació amb i sense autocorrelació dels errors. Variables Instrumentals.
- 5.4 Contrastos d'autocorrelació dels errors.

### 6. Sèries temporals: predicció amb models ARIMA

- 6.1 Enfocaments per a la predicció econòmica.
- 6.2 Processos ARMA i ARIMA.
- 6.3 Funció d'autocorrelació simple i Funció d'autocorrelació Parcial.
- 6.4 Identificació, estimació, validació i predicció.

**VOLUM DE TREBALL (HORES)****ACTIVITATS PRESENCIALS**

Activitat	Hores
Teoria	30,00
Pràctiques a l'aula	30,00
<b>Total hores</b>	<b>60,00</b>

**ACTIVITATS NO PRESENCIALS**

Activitat	Hores
Assistència a altres activitats	0,00
Elaboració de treballs individuals o en grup	10,00
Estudi i treball autònom	50,00
Preparació de classes	30,00
Preparació d'activitats d'avaluació	0,00
Resolució de casos pràctics	0,00
<b>Total hores</b>	<b>90,00</b>

**METODOLOGIA DOCENT**

- En les classes teòriques es combina l'exposició de la matèria a tractar en cada sessió, amb el suport de la projecció de resums i amb la resolució d'exercicis i casos pràctics proposats pel professor, per a la millor comprensió de la teoria.

- En les classes pràctiques es resoldran exercicis en la pissarra, per part del professor i de l'alumne i es realitzaran exercicis amb l'ordinador tant de forma individual com en grups.

- A més de consultar la bibliografia de referència, l'alumne disposarà del material de treball elaborat per a cada tema, tant teòric com pràctic, que es publicarà a l'aula virtual amb la deguda antelació.

Els treballs pràctics aniran orientats a l'elaboració d'un informe que expliqui els passos realitzats durant l'anàlisi d'un problema econòmic: plantejament i motivació del problema i de la seva anàlisi, cerca d'un model econòmic senzill que relacione les variables rellevants del problema i cerca d'informació estadística sobre aquestes variables. Es presentaran algunes de les bases de dades econòmics tant de caràcter nacional com internacional (bases de dades electròniques disponibles en la pàgina web de la Biblioteca de CC socials: [http://biblioteca.uv.es/valenciano/recursos\\_electronicos/bases\\_dades/acces.php](http://biblioteca.uv.es/valenciano/recursos_electronicos/bases_dades/acces.php); com el compendi estadístic de l'OCDE o bases de dades d'organisme nacionals o internacionals com en institut Nacional d'Estadística ([www.ine.es](http://www.ine.es)) Eurostat (<http://ec.europa.eu/eurostat>), Nacions Unides (<http://unstats.un.org/unsd/default.htm>), o les Penn World Tables (<https://www.rug.nl/ggdc/productivity/pwt/>)



/p>

## AVALUACIÓ

L'assignatura utilitza el següent procediment d'avaluació de competències:

**Prova de síntesi.** Prova escrita, consistent en un examen que constarà de qüestions teòriques i/o teoricopràctiques i/o de problemes al voltant de tot el contingut de l'assignatura que figura en la Guia Acadèmica. Esta prova conformarà el 70% de la nota de l'estudiant.

**Avaluació contínua de l'estudiant** a partir de l'elaboració d'informes breus, resolució d'exercicis o resposta de qüestionaris sobre els continguts que figuren en la Guia al llarg del curs. Aquesta avaluació s'organitzarà entorn de la realització i presentació d'un màxim de **3 entregues** que se sol·licitaran a l'alumne al llarg del curs. Esta avaluació contínua **de caràcter no recuperable** conformarà el 30% de la nota de l'estudiant i sols es pot fer i entregar fins a la primera convocatòria del examen.

**Nota Final:** la nota final serà la **suma ponderada** de la prova de síntesi i de l'avaluació contínua (no es recuperable, llavors l'avaluació continua no es pot fer i/o presentar per a la segona convocatòria). Per a sumar l'avaluació contínua és imprescindible superar la prova de síntesi. En cas contrari la nota final de l'assignatura no podrà superar un màxim de 4.5 punts.

**Aquesta avaluació s'aplicarà tant en la primera com en la segona convocatòria de l'assignatura.**

**L'alumne baix sospita d'intent de copia, plagi o suplantació en la realització de les entregues o de l'examen tindrà com a nota final un zero.**

La normativa oficial del centre respecte a avaluació i qualificació d'assignatures pot consultar-se en el següent enllaç:

[https://www.uv.es/graus/normatives/2017\\_108\\_reglament\\_avaluacio\\_qualificacio.pdf](https://www.uv.es/graus/normatives/2017_108_reglament_avaluacio_qualificacio.pdf)

## BIBLIOGRAFIA

- 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.