

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

Código: 36804
Nombre: Econometría II
Ciclo: Grado
Créditos ECTS: 6
Curso académico: 2025-26

TITULACIONES

Titulación	Centro	Curso	Periodo
1933 - Doble Grado en Derecho y Economía	Facultat d'Economia	4	Segundo cuatrimestre

MATERIAS

Titulación	Materia	Carácter
1933 - Doble Grado en Derecho y Economía	Asignaturas de cuarto curso	OBLIGATORIA

COORDINACIÓN

BENEITO LOPEZ PILAR

RESUMEN

La asignatura Econometría II tiene carácter obligatorio y semestral, con una carga lectiva total de 6 créditos ECTS (150 horas), impartándose en el cuarto curso del Grado de Derecho-Economía (en el grado de Economía, se imparte en el tercer curso). 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 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 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.

Los contenidos de la asignatura Econometría II se basan en los conocimientos adquiridos en la Econometría I para hacer extensiones hacia problemas econométricos y métodos específicos. Una primera parte del curso se dedica al estudio de la endogeneidad y en algunos de los métodos clásicos y actuales para 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 variables binarias (modelos Logit y Probit). La segunda parte se dedica al estudio de las series temporales (modelos dinámicos, estudio de estacionariedad, modelos ARIMA para predicción). Los estudiantes deberán utilizar conocimientos previos provenientes de



diferentes materias que han cursado previamente: álgebra, cálculo, estadística, Econometría I.

Así, esta asignatura permite la investigación de problemas reales con los datos. Habida cuenta de que la economía, así como el resto de ciencias sociales, es cada vez en mayor grado una 'ciencia de datos', esta asignatura se convierte en imprescindible en el currículo académico del estudiante de Derecho-Economía.

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

- Relación con otras asignaturas de la misma titulación: esta asignatura no cuenta con restricciones de matrícula respecto de otras asignaturas del plan de estudios, si bien es muy difícil cursarla con éxito sin haber superado la asignatura de Econometría I.
- Otros tipos de requisitos: para afrontar con éxito esta asignatura, es conveniente que el estudiante recuerde y maneje los conocimientos de álgebra, cálculo, estadística y Teoría Económica que ha aprendido en cursos anteriores.

COMPETENCIAS / RESULTADOS DE APRENDIZAJE

DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS

1. Sesgo/Inconsistencia de 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
 - 1.2.1 Ejemplo: el equilibrio de mercado
 - 1.2.2 Modelo estructural y modelo reducido. Caso simple de 2 ecuaciones.
 - 1.2.3 Restricciones de exclusión para identificar un efecto causal. Condición de rango y de orden.
- 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 ventaja 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 de 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-Prácticas	60,00
Total horas	60,00

ACTIVIDADES NO PRESENCIALES

Actividad	Horas
Asistencia a otras actividades	0,00
Elaboración de trabajos individuales o en grupo	20,00
Estudio y trabajo autónomo	50,00
Preparación de clases	20,00
Preparación de actividades de evaluación	0,00
Resolución de casos prácticos	0,00
Total horas	90,00

METODOLOGÍA DOCENTE

Se minimizan los aspectos formales, primando la discusión intuitiva de los conceptos y el planteamiento de preguntas de interés económico que puedan responderse con el manejo de datos reales. Se trata de que el alumno alcance un dominio práctico de la econometría.

En las clases se combina la exposición de la materia a tratar en cada sesión, apoyada en la propuesta de casos prácticos que servirán para motivar las preguntas a las que queremos dar respuesta con la teoría y práctica econométrica. Las prácticas consistirán tanto en la resolución de ejercicios analíticos, por parte del profesor y del alumno, como a la resolución de casos prácticos con la utilización del paquete R utilizando el ordenador.

Las prácticas así como la asistencia y participación activa en las clases constituirá parte de la evaluación continua de la asignatura.

EVALUACIÓN

En la asignatura se utilizará el siguiente procedimiento de evaluación:

- Prueba de síntesis (70% de la nota final): 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.
- Evaluación continua del estudiante a partir de la resolución de ejercicios y la elaboración de trabajos (30% de la nota final). Dicha evaluación consistirá en la realización y presentación de ejercicios tanto



analíticos como con ordenador para cada tema que irá unida a la participación del estudiante en las clases prácticas, así como a la entrega de cualquier otro trabajo que el profesor estime conveniente realizar a lo largo del semestre. Esta evaluación continua es de carácter no recuperable, si bien su calificación podrá guardarse hasta la segunda convocatoria en caso de que el estudiante no supere la prueba de síntesis en la primera.

La nota final será la suma ponderada de la prueba de síntesis y de la evaluación continua (no recuperable). Para sumar la evaluación continua es imprescindible superar la prueba de síntesis.

En caso de no superar la prueba de síntesis, la nota que figurará en actas será la nota obtenida en dicha prueba (calculada sobre 10).

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.

Gujarati, D. y Porter D.C. (2010) Econometría (5ª Edición). McGraw-Hill. (English version: Gujarati, D. and Porter D.C. (2009) Basic Econometrics, 5th Edition). McGraw- Hill.

Stock J.H. y Watson M.M. (2012) Introducción a la Econometría. (3ª Edition). Pearson (English version: Stock J.H. y Watson M.M. (2020) Introduction to Econometrics. 4th Edition, Global Edition). Pearson.

Greene, W. (1999). Análisis Econométrico (3ª edición). Prentice-Hall. Madrid English version: Green (2018) Econometric Analysis. (8th Edition), Pearson.

Heiss, F. (2016) Using R for Introductory Econometrics. Using the Independent Publishing Platform CreateSpace.

Econometría en YouTube (en inglés): <https://www.youtube.com/playlist?>



list=PLwJRxp3bIEvZyQBTTOMFRP_TDaSdly3gU