

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

Codi: 36804
Nom: Econometria II
Cicle: Grau
Crèdits ECTS: 6
Curs acadèmic: 2025-26

TITULACIONS

Titulació	Centre	Curs	Període
1933 - Doble Grau en Dret i Economia	Facultat d'Economia	4	Segon quadrimestre

MATÈRIES

Titulació	Matèria	Caràcter
1933 - Doble Grau en Dret i Economia	Asignaturas de cuarto curso	OBLIGATÒRIA

COORDINACIÓ

BENEITO LOPEZ PILAR

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 quart curs del Grau de Dret-Economia (en el grau d'Economia, s'impartix en el tercer curs). La matèria Econometria, comprén 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 els coneixements bàsics de la disciplina d'Econometria, que conjumina conceptes provinents de la Teoria Econòmica, de les Matemàtiques i l'Estadística, i la fi de la qual és proveir dels instruments adequats per a abordar l'anàlisi de la realitat econòmica i la seua 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.

Els continguts de l'assignatura Econometria II es basen en els coneixements adquirits en l'Econometria I per a fer extensions cap a problemes econòmics i mètodes específics. Una primera part del curs es dedica a l'estudi de la endogeneidad i en alguns dels mètodes clàssics i actuals per a identificació de relacions causals. Es presenten a més les dades de panell (estimació d'efectes fixos d'unitat i de temps), alguns dels mètodes d'avaluació de polítiques (anàlisi causal) més utilitzats actualment, i l'estimació de variables binàries (models Logit i Probit). La segona part es dedica a l'estudi de les sèries temporals (models dinàmics, estudi de estacionariedad, models ARIMA per a predicció). Els estudiants hauran d'utilitzar coneixements previs provinents de diferents matèries que han cursat prèviament: àlgebra, càlcul,



estadística, Econometria I.

Així, esta assignatura permet la investigació de problemes reals amb les dades. Tenint en compte que l'economia, així com la resta de ciències socials, és cada vegada en major grau una 'ciència de dades', esta assignatura es convertix en imprescindible en el currícul acadèmic de l'estudiant de Dret-Economia.

CONEXEMENTS 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

- Relació amb altres assignatures de la mateixa titulació: esta assignatura no compta amb restriccions de matrícula respecte d'altres assignatures del pla d'estudis, si bé és molt difícil cursar-la amb èxit sense haver superat l'assignatura d'Econometria I.
- Altres tipus de requisits: per a afrontar amb èxit esta assignatura, és convenient que l'estudiant recorde i manege els coneixements d'àlgebra, càlcul, estadística i Teoria Econòmica que ha après en cursos anteriors.

COMPETÈNCIES / RESULTATS D' APRENTATGE

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 SIMULTANEÏTAT en les relacions econòmiques

-1.2.1 Exemple: l'equilibri de mercat

- 1.2.2 Model estructural i model reduït. Cas simple de 2 equacions.

-1.2.3 Restriccions d'exclusió per a identificar un efecte causal. Condició de rang i d'orde.

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)
- 2.3 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·lisme 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-Pràctiques	60,00
Total hores	60,00

ACTIVITATS NO PRESENCIALS

Activitat	Hores
Assistència a altres activitats	0,00
Elaboració de treballs individuals o en grup	20,00
Estudi i treball autònom	50,00
Preparació de classes	20,00
Preparació d'activitats d'avaluació	0,00
Resolució de casos pràctics	0,00
Total hores	90,00

METODOLOGIA DOCENT

Es minimitzen els aspectes formals, prevalent la discussió intuïtiva dels conceptes i el plantejament de preguntes d'interés econòmic que puguen respondre's amb el maneig de dades reals. Es tracta que l'alumne aconseguisca un domini pràctic de l'econometria.

En les classes es combina l'exposició de la matèria a tractar en cada sessió, recolzada en la proposta de casos pràctics que serviran per a motivar les preguntes a les quals volem donar resposta amb la teoria i pràctica economètrica. Les pràctiques consistiran tant en la resolució d'exercicis analítics, per part del professor i de l'alumne, com a la resolució de casos pràctics amb la utilització del paquet R utilitzant l'ordinador.

Les pràctiques així com l'assistència i participació activa en les classes constituirà part de l'avaluació contínua de l'assignatura.

AVALUACIÓ

En l'assignatura s'utilitzarà el següent procediment d'avaluació:

- Prova de síntesi (70% de la nota final): Prova escrita, consistent en un examen que constarà de qüestions teòriques i/o teoricopràctiques i/o de problemes sobretot el contingut de l'assignatura que figura en la Guia Acadèmica.
- Avaluació contínua de l'estudiant a partir de la resolució d'exercicis i l'elaboració de treballs (30% de la



nota final). Esta avaluació consistirà en la realització i presentació d'exercicis tant analítics com amb ordinador per a cada tema que anirà unida a la participació de l'estudiant en les classes pràctiques, així com al lliurament de qualsevol altre treball que el professor estime convenient realitzar al llarg del semestre. Esta avaluació contínua és de caràcter no recuperable, si bé la seua qualificació podrà guardar-se fins a la segona convocatòria en cas que l'estudiant no supere la prova de síntesi en la primera.

La nota final serà la suma ponderada de la prova de síntesi i de l'avaluació contínua (no recuperable). Per a sumar l'avaluació contínua és imprescindible superar la prova de síntesi.

En cas de no superar la prova de síntesi, la nota que figurarà en actes serà la nota obtinguda en esta prova (calculada sobre 10).

L'alumne sota sospita d'intent de còpia, plagi o suplantació en la realització dels lliuraments o de l'examen tindrà una nota final de 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

BIBLIOGRAFIA

Wooldridge, J (2016). Introducció a la econometria. 5ª Edició. Cengage Learning. English version. Wooldridge, J (2020). Introductory Econometrics: A Modern Approach. 7th Edition. Cengage Learning.

Gujarati, D. y Porter D.C. (2010) Econometria (5ª Edició). 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) Introducció a la Econometria. (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 Económico (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.

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



list=PLwJRxp3bIEvZyQBTTOMFRP_TDaSdly3gU