



FICHA IDENTIFICATIVA

DATOS DE LA ASIGNATURA

Código: 44942

Nombre: Econometría

Ciclo: Máster Universitario Oficial

Créditos ECTS: 5

Curso académico: 2025-26

TITULACIONES

Titulación	Centro	Curso	Periodo
2242 - Máster Universitario en Economía	Facultat d'Economia	1	Primer cuatrimestre

MATERIAS

Titulación	Materia	Carácter
2242 - Máster Universitario en Economía	Materia Instrumental	OBLIGATORIA

COORDINACIÓN

BENEITO LOPEZ PILAR

BRETO MARTINEZ CARLES

RESUMEN

Este curso presenta los principales métodos de análisis econométrico y su aplicación a la economía. El objetivo principal del curso es enseñar a los estudiantes cómo convertirse en generadores y usuarios críticos de la investigación empírica. Esto se logra enfocándose tanto en las propiedades teóricas como en la implementación práctica de las técnicas.

El curso comienza introduciendo el modelo clásico de regresión lineal, supuestos sobre las variables explicativas y las perturbaciones, las propiedades del estimador de mínimos cuadrados y las pruebas de hipótesis. Esta primera parte del curso trata de proporcionar una base homogénea a todos los estudiantes, aquellos que tienen alguna capacitación en econometría de grado y aquellos que no la tienen. Una segunda parte del curso introduce las características de las perturbaciones no esféricas y el modelo generalizado de mínimos cuadrados, los problemas de endogeneidad y la estimación de variables instrumentales, el método generalizado de momentos, el método de máxima verosimilitud y la estimación de ecuaciones simultáneas.

El curso también tiene como objetivo desarrollar las habilidades de los estudiantes para aplicar los métodos a datos reales utilizando el programa de econometría STATA.



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

Los estudiantes se beneficiarán enormemente de cualquier curso introductorio de pregrado de econometría. Sin embargo, el curso está orientado también a aquellos sin conocimientos previos de econometría. Se supone que los estudiantes tienen algo de capacitación en herramientas estadísticas básicas y álgebra lineal / matricial, que se utilizan ampliamente en el curso.

COMPETENCIAS / RESULTADOS DE APRENDIZAJE

-

Aplicar los conocimientos adquiridos en la identificación de salidas profesionales y yacimientos de empleo, así como adquirir las habilidades personales que faciliten la inserción y desarrollo profesional. Para ello: conocer y saber usar las técnicas y herramientas de búsqueda de empleo y considerar el emprendimiento como una alternativa profesional.

Conocer las bases de datos y bibliográficas necesarias para la realización de trabajos de investigación económica.

Obtener capacidades lingüísticas y tecnológicas: capacidad para utilizar el inglés en el ámbito científico de la economía y para utilizar las TIC en el ámbito del estudio y la investigación de la economía.

Poseer y comprender conocimientos que aporten una base u oportunidad de ser originales en el desarrollo y/o aplicación de ideas, a menudo en un contexto de investigación.

Que los/las estudiantes posean las habilidades de aprendizaje que les permitan continuar estudiando de un modo que habrá de ser en gran medida autodirigido o autónomo

Saber manejar bases de datos y su procesamiento utilizando las técnicas y los paquetes informáticos más adecuados y actuales.

Saber utilizar adecuadamente las técnicas econométricas aplicadas al análisis del funcionamiento de la economía.

DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS

1. REGRESIÓN LINEAL CON ERRORES i.i.d.



1. Econometría

1. REGRESIÓN LINEAL CON ERRORES i.i.d.

- 1.1 Introducción.
- 1.2 Estimación de MCO.
- 1.3 Contrastes Hipótesis.
- 1.4 Variable Ficticias

2. REGRESIÓN CON ERRORES no-i.i.d.

- 2.1 Tipos de desviaciones de i.i.d. errores: heterocedasticidad y autocorrelación.
- 2.2 Errores robustos.
- 2.3 El estimador de mínimos cuadrados generalizado, GLS (y GLS factible).
- 2.4 Correcciones más comunes en la práctica.

3. MODELOS DE ECUACIONES SIMULTÁNEAS

- 3.1 La naturaleza de los modelos de ecuaciones simultáneas.
- 3.2 Sesgo de simultaneidad en OLS.
- 3.3 Identificación y estimación de una ecuación estructural.

4. ENDOGENEIDAD

- 4.1 Endogeneidad en las relaciones económicas.
- 4.2 Estimación de variables instrumentales y 2SLS.
- 4.3 Tests de sobreidentificación (validez de instrumentos).
- 4.4 Tests de relevancia de los instrumentos.
- 4.5 Tests de endogeneidad.

5. MÉTODOS DE IDENTIFICACIÓN CAUSAL BASADOS EN 'EL CONTRAFACTUAL' (métodos para evaluación de políticas)

- 5.1 Intuición: "¿Qué habría pasado si...?". Paralelismo con los datos experimentales.
- 5.2 Algunos estimadores de 'diseño': Estimadores de 'emparejamiento' (,matching), estimación diferencias-en-diferencias, regresión en discontinuidad y el método de control sintético.
- 5.3 Condiciones necesarias en cada caso para "validar" el método.
- 5.4 Pruebas básicas de validación de cada método.

6. ESTIMACIÓN POR MÁXIMA VEROSIMILITUD

- 6.1 Introducción.
- 6.2 Marco general para la estimación condicional de máxima verosimilitud (CMV).
- 6.3 Consistencia de CMV.
- 6.4 Normalidad asintótica y estimación de varianza asintótica.
- 6.5 Contrastes basados en la estimación de MV.

Sesiones prácticas: INTRODUCCIÓN A STATA



- Introducción a elementos básicos.
- Obtener los datos en STATA.
- Transformaciones de datos comunes.
- Organización y manejo de datos económicos.
- Aplicación de métodos.

VOLUMEN DE TRABAJO (HORAS)

ACTIVIDADES PRESENCIALES

Actividad	Horas
Teoría	40,00
Prácticas en aula	10,00
Total horas	50,00

ACTIVIDADES NO PRESENCIALES

Actividad	Horas
Asistencia a otras actividades	0,00
Elaboración de trabajos individuales o en grupo	0,00
Estudio y trabajo autónomo	75,00
Preparación de clases	0,00
Preparación de actividades de evaluación	0,00
Resolución de casos prácticos	0,00
Total horas	75,00

METODOLOGÍA DOCENTE

EVALUACIÓN

Este curso utilizará el siguiente procedimiento de evaluación:

- Examen final (70% de la nota final): Examen escrito, consistente en cuestiones y/o problemas teóricos y/o teórico-prácticos.

- Evaluación continua del alumno basada en la resolución de ejercicios y la elaboración de trabajos (30% de la nota final). Esta evaluación consistirá en la realización y presentación de ejercicios tanto analíticos como informáticos de cada asignatura, que estarán vinculados a la participación del alumno en las clases prácticas, así como la entrega de cualquier otro trabajo que el profesor estime oportuno realizar a lo largo del semestre. Esta evaluación continua no es recuperable, aunque se podrá mantener la nota hasta la segunda convocatoria en el caso de que el alumno no supere el examen final en la primera convocatoria.

La nota final será la suma ponderada del examen final y la evaluación continua (no recuperable). Para sumar la evaluación continua es imprescindible aprobar el examen. En caso de suspender el examen final, la nota que aparecerá en las listas oficiales será la obtenida en dicho examen (calculada sobre 10).



Los alumnos sospechosos de intento de copia, plagio o suplantación de identidad en la entrega de trabajos o en el examen recibirán una calificación final de cero.

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

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

BIBLIOGRAFÍA

- Wooldridge, J.M. (2013). *Introductory Econometrics: A Modern Approach*, 5th edition. Cengage Learning (Previous editions: 2009, 2006, 2003).
- Greene, W.H. (2012). *Econometric Analysis*, 7th edition. Prentice Hall.
- Baum, Ch. F. (2006). *An Introduction to Modern Econometrics Using STATA*. STATA-Press.
- Wooldridge, J.M. (2002). *Econometric Analysis of Cross-Section and Panel Data*. The MIT Press.
- Stock J.H. and Watson M.M. (2020) *Introduction to Econometrics*. (4th Edition, Global Edition). Pearson.
- *Econometrics in YouTube* (last accessed July 2024): https://www.youtube.com/playlist?list=PLwJRxp3blEvZyQBTTOMFRP_TDaSdly3gU