UAlg
UNIVERSIDADE DO ALGARVE

English version at the end of this document

Ano Letivo	2017-18
Unidade Curricular	ECONOMETRIA II
Cursos	ECONOMIA (1.º ciclo)
Unidade Orgânica	Faculdade de Economia
Código da Unidade Curricular	14401028
Área Científica	MÉTODOS QUANTITATIVOS
Sigla	
Línguas de Aprendizagem	Português - PT
Modalidade de ensino	Presencial.
Docente Responsável	Jorge Miguel Lopo Gonçalves Andraz

DOCENTE	TIPO DE AULA	TURMAS	TOTAL HORAS DE CONTACTO (*)
Jorge Miguel Lopo Gonçalves Andraz	OT; PL; T	T1; PL1; OT1	30T; 30PL; 15OT

* Para turmas lecionadas conjuntamente, apenas é contabilizada a carga horária de uma delas.

ANO	PERÍODO DE FUNCIONAMENTO*	HORAS DE CONTACTO	HORAS TOTAIS DE TRABALHO	ECTS
3º	S2	30T; 30PL; 15OT	168	6

* A-Anual;S-Semestral;Q-Quadrimestral;T-Trimestral

Precedências

Sem precedências

Conhecimentos Prévios recomendados

Estatística I, Estatística II, Econometria I

Objetivos de aprendizagem (conhecimentos, aptidões e competências)

Esta unidade curricular é leccionada no seguimento da unidade de Econometria I e espera-se, com esta unidade curricular que os estudantes obtenham as seguintes competências:
1. Conhecimento profundo dos aspetos da análise quantitativa empírica de dados macroeconómicos;
2. Domínio dos aspetos teóricos da modelização e a compreensão intuitiva de questões centrais da modelização, estimação e de diagnóstico;
3. Capacidades de raciocínio, conhecimento e compreensão para realizarem análises empíricas associadas a modelos económicos;
4. Desenvolvimento da capacidade de análise crítica de resultados.

Conteúdos programáticos

1. Violação das hipóteses clássicas do modelo de regressão

2. Endogeneidade e variáveis instrumentais

3. Modelos de equações simultâneas

4. Conceitos fundamentais sobre séries temporais

5. Modelação de séries temporias estacionárias

6. Modelação de séries temporais não estacionárias

7. Estimação e testes de diagnóstico

8. Previsão

9. Modelos com regressores adicionais: os modelos autorregressivos e de desfasamento distribuído

10. Cointegração e mecanismo de correção de erros

Metodologias de ensino (avaliação incluída)

As aulas seguem um figurino de aulas teóricas e de aulas práticas.
As aulas teóricas são destinadas à apresentação dos conteúdos programáticos e as aulas práticas destinam-se à resolução de exercícios.
A avaliação de conhecimentos comporta dois modelos
Avaliação Contínua: podem optar por este modelo de avaliação todos os alunos inscritos, sendo necessário que assistam a, pelo menos, 75% das aulas teóricas e a 75% das aulas práticas
O modelo compreende dois testes individuais, cada um com a ponderação de 35% e dois quizzes, cada um com a ponderação de 15%.
Ficam aprovados os alunos que obtenham, como classificação final, uma média aritmética ponderada igual ou superior a 9,5 valores, desde que em cada teste obtenham uma nota mínima de 7,5 valores.
Avaliação por Exame Final: Os alunos reprovados na avaliação contínua, bem como os que não se submeteram a esse tipo de avaliação, são avaliados por exame final.

Bibliografia principal

Andraz, J. M. (2016), Lições de Econometria: da teoria à prática, *mimeo* .

Wooldridge, J. (2009), Introductory Econometrics, South-Western, 4th Edition.

Gujarati, D. e Porter, D. (2009), Basic Econometrics, McGraw-Hill, 5th Edition.

UAlg
UNIVERSIDADE DO ALGARVE

Academic Year	2017-18
Course unit	ECONOMETRICS II
Courses	ECONOMICS (1st Cycle)
Faculty / School	Faculdade de Economia
Main Scientific Area	MÉTODOS QUANTITATIVOS
Acronym	
Language of instruction	Portuguese - PT
Teaching/Learning modality	Face-to-face
Coordinating teacher	Jorge Miguel Lopo Gonçalves Andraz

Teaching staff	Type	Classes	Hours (*)
Jorge Miguel Lopo Gonçalves Andraz	OT; PL; T	T1; PL1; OT1	30T; 30PL; 15OT

* For classes taught jointly, it is only accounted the workload of one.

Contact hours

T	TP	PL	TC	S	E	OT	O	Total
30	0	30	0	0	0	15	0	168

T - Theoretical; TP - Theoretical and practical ; PL - Practical and laboratorial; TC - Field Work; S - Seminar; E - Training; OT - Tutorial; O - Other

Pre-requisites

no pre-requisites

Prior knowledge and skills

Statistics I, Statistics II, Econometrics I

The students intended learning outcomes (knowledge, skills and competences)

This unit is taught as a natural sequence of Econometrics I and it is intended to give the students:
1. A rigorous knowledge of the main issues regarding empirical quantitative analysis of macroeconomic data;
2. A deep understanding of the theoretical issues of econometric modeling, estimation and diagnostic testing procedures;
3. Capacity to perform empirical analysis when working with economic models;
4. Capacity to develop a critical data analysis

Syllabus

1. Violation of the classical assumptions
2. Endogeneity and instrumental variables
3. Simultaneous equations models
4. Time series concepts
5. Stationary time series models and their characteristics

6. Nonstationary time series models and their characteristics

7. Models estimation and diagnostic testing
6. Forecasting
9. Autoregressive-Distributed Lag models
10. Cointegration and the correction errors mechanism

Teaching methodologies (including evaluation)

The Course is taught on a weekly basis through theoretical and practical classes. The lectures are expository and are sustained in the manual recommended; the practical lessons, participatory in nature, are intended to solve exercises. The evaluation supports two models. Continuous evaluation: to assess to this model, the student has to be present at least in 75% of the theoretical and practical lessons. The model consists in two individual tests (each test with a weight of 35%) and two quizzes (each with a weight of 15%).

To be approved, the student must get an average score of at least 9.5 out of 20, and in each test a minimum grade of 7.5, out of 20. Evaluation by final exam: the students who did not get approval in the continuous evaluation, and those who did not choose it, will be evaluated by a final exam.

Main Bibliography

Andraz, J. M. (2016), Lições de Econometria: da teoria à prática, *mimeo* .

Wooldridge, J. (2009), Introductory Econometrics, South-Western, 4th Edition.

Gujarati, D. e Porter, D. (2009), Basic Econometrics, McGraw-Hill, 5th Edition.