
Ano Letivo 2021-22

Unidade Curricular ECONOMETRIA II

Cursos ECONOMIA (1.º ciclo)

Unidade Orgânica Faculdade de Economia

Código da Unidade Curricular 14401028

Área Científica MÉTODOS QUANTITATIVOS

Sigla

Código CNAEF (3 dígitos) 469

**Contributo para os Objetivos de
Desenvolvimento Sustentável - 4
ODS (Indicar até 3 objetivos)**

Línguas de Aprendizagem Português - PT

Modalidade de ensino

Presencial (e/ou à distância).

Docente Responsável

Jorge Miguel Lopo Gonçalves Andraz

DOCENTE	TIPO DE AULA	TURMAS	TOTAL HORAS DE CONTACTO (*)
Jorge Miguel Lopo Gonçalves Andraz	O; OT; PL; T	T1; PL1; OT1; LO1	26T; 26PL; 9OT; 4O

* 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	26T; 26PL; 9OT; 4O	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 lecionada 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 especificação, estimação, diagnóstico e previsão;
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 temporais 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.

1. Avaliação Contínua: podem optar por este modelo de avaliação todos os alunos inscritos. O modelo compreende dois testes individuais, cada um com a ponderação de 50%. Em cada teste é exigida uma nota mínima de 7,5 valores. Ficam aprovados os alunos que obtenham, como classificação final, uma média aritmética igual ou superior a 9,5 valores.
 2. 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, o qual versa sobre toda a matéria.
-

Bibliografia principal

Wooldridge, J. (2018), *Introductory Econometrics: A Modern Approach*, Cengage Learning, 7th Edition.

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

Academic Year 2021-22

Course unit ECONOMETRICS II

Courses ECONOMICS (1st Cycle)

Faculty / School THE FACULTY OF ECONOMICS

Main Scientific Area

Acronym

CNAEF code (3 digits) 469

Contribution to Sustainable Development Goals - SGD (Designate up to 3 objectives) 4

Language of instruction Portuguese - PT

Teaching/Learning modality Face-to-face in-class teaching (and/or distance learning).

Coordinating teacher Jorge Miguel Lopo Gonçalves Andraz

Teaching staff	Type	Classes	Hours (*)
Jorge Miguel Lopo Gonçalves Andraz	O; OT; PL; T	T1; PL1; OT1; LO1	26T; 26PL; 9OT; 4O

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

Contact hours	T	TP	PL	TC	S	E	OT	O	Total
	26	0	26	0	0	0	9	4	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, diagnostic testing procedures, and forecasting;
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.

1. Continuous evaluation: The model consists on two individual tests (each test with a weight of 50% in the final grade). To be approved, the student must get an average score of at least 9.5 out of 20, and a minimum grade of 7.5, out of 20 in each test.
2. Evaluation by final exam: the students who did not get approval in the continuous evaluation, as well as those who did not choose it, will be evaluated by a final exam which covers all the syllabus.

Main Bibliography

Wooldridge, J. (2018), Introductory Econometrics: A Modern Approach, Cengage Learning, 7th Edition.

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