
Ano Letivo 2022-23

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. Modelos de séries temporais: Variáveis estacionárias
 5. Modelos de séries temporais: variáveis não estacionárias
 6. Modelos ARDL
-

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

Brooks, C. (2019) Introductory Econometrics for Finance, 4th Edition, Cambridge.

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

Hill, R., Griffiths, W., Lim, G. (2018), Principles of Econometrics, 5th Edition, Wiley.

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

Academic Year 2022-23

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 of the regression model
 2. Endogeneity and instrumental variables
 3. Simultaneous equation models
 4. Time series models: Stationary variables
 5. Time series models: non-stationary variables
 6. ARDL models
-

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

Brooks, C. (2019) *Introductory Econometrics for Finance*, 4th Edition, Cambridge.

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

Hill, R., Griffiths, W., Lim, G. (2018), *Principles of Econometrics*, 5th Edition, Wiley.

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