

---

**Ano Letivo** 2023-24

---

**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 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 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
  7. Cointegração
- 

### **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 e desde 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 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.

#### 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.

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** 2023-24

---

**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
  7. Cointegration
- 

### **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

All registered students can opt for this assessment model and must attend at least 75% of the theoretical classes and 75% of the practical classes. This assessment model comprises two individual tests, each with a weighting of 50% in the final grade. A minimum mark of 7.5 is required for each test. Students who obtain an arithmetic average of 9.5 or more will pass.

#### 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.

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.