

ISCTE-IUL
Licenciatura em Economia
Econometria II
3º Ano, 1º Semestre – 2011/2012

Docente: Luis Filipe Martins

luis.martins@iscte.pt

<http://iscte.pt/~lfsm>

Gab.: B706; **Tel.:** 217903439; **Ext.:** 777061; **Cacifo:** 170

Aulas: (2f e 4f das 11:10 às 12:30 e 6f das 9:40 às 11:00)

Website da Disciplina: Teaching/Ensino @ <http://iscte.pt/~lfsm>

Horário de Atendimento: (2f e 4f das 9:00 às 11:00 e por marcação).

Descrição da Disciplina: A disciplina é a segunda parte da sequência dos dois cursos *Econometria I* e *Econometria II*. O objectivo principal da disciplina é fornecer aos alunos do curso de *Economia* conhecimentos avançados numa série de tópicos da análise moderna da regressão linear, com especial enfoque em modelos com dados temporais. Neste sentido, é fundamental que o aluno não apenas domine aspectos teóricos do programa mas principalmente que saiba, de uma forma crítica, aplicar esses mesmos conhecimentos ao desenvolvimento de projectos empíricos associados a modelos de natureza económica.

- *Nº de créditos (ECTS):* 6
- *Tempo de trabalho total (horas):* 150 (55 presenciais – 14 semanas - e 95 de trabalho autónomo)

Pré-requisito: Econometria I.

Bibliografia:

Manual (obrigatório): (W) Wooldridge, J.M. (2003), “Introductory Econometrics: A Modern Approach”, 2nd Ed., South Western Publishers.

Apontamentos do docente.

Opcional: Kennedy, P. (2003), “A Guide to Econometrics”, 5th Ed., MIT Press.

Outras Referências:

- Stock, J.H. and Watson, M.W. (2003); Griffiths, W.E., Hill, R.C. and Judge, G.G. (1993); Ramanathan (2001)
- Hayashi, F. (2000); Gujarati, D.N. (2003); Davidson, J. (2000); Greene, W.H. (2003); Johnston, J. and Dinardo, J. (1997); Maddala (2001)
- Arellano (2003); Enders, W. (2005); Hamilton, J. (1994)

Programa da Disciplina:

1. (2 aulas) Revisão de Introdução à Econometria: (W)1,2,3,4,5,(6),7.1-7.4
2. (18 aulas) Introdução à regressão com séries temporais
 - 2.1. Alguns conceitos em Time Series: (W)10.1,10.2
 - 2.2. Autocorrelação nos erros e consequências para o OLS: (W)10.3,11.2,12.1
 - 2.3. Testes para a detecção de autocorrelação dos erros: (W)12.2
 - 2.4. Estimação robusta de $V(b)$: (W)12.3, 12.4, 12.5
 - 2.5. Estimação eficiente e procedimentos iterativos e o estimador FGLS: (W)12.3
 - 2.6. Modelos com defasamentos e modelos dinâmicos: (W) 18.1
 - 2.7. Testes de raiz unitária: (W) 18.2
 - 2.8. Cointegração e modelo com mecanismo de correção de erros: (W) 18.3,18.4
 - 2.9. Previsão: (W) 18.5
 - 2.10. O Modelo ARCH: (W) 12.6
3. (6 aulas) Endogeneidade e estimação com variáveis instrumentais
 - 3.1. Definição, consequências para o OLS: (W)15.1
 - 3.2. O método das variáveis instrumentais e o estimador 2SLS: (W)15.2 - 15.4
 - 3.3. Testes para a detecção de endogeneidade e sobre-identificação: (W)15.5
4. (6 aulas) Modelos de escolha binária
 - 4.1. Introdução: (W)7.5,17.1
 - 4.2. O modelo probabilístico linear: (W)7.5
 - 4.3. Os modelos Probit e Logit e sua estimação por ML: (W)17.1
 - 4.4. O modelo Tobit: (W)17.2
5. (6 aulas) Modelos com dados de painel
 - 5.1. Motivação: (W)13.3,13.4,13.5
 - 5.2. Modelo e estimação de efeitos fixos: (W)14.1
 - 5.3. O modelo de efeitos aleatórios: (W)14.2
 - 5.4. Efeitos aleatórios versus efeitos fixos: (W)14.2

Avaliação:

A aprovação na disciplina realiza-se por avaliação contínua ou exame final.

1. *Avaliação contínua:*

Teste #1 (35% da nota), (data e sala a confirmar)

Teste #2 (35% da nota), coincide com exame de 1ª Época (a confirmar - GARE)

Trabalho de grupo, presença e participação nas aulas (30% da nota).

2. *Exame final:* Aplicam-se as normas gerais (prova escrita, 100% da nota).

Observações:

- Dispensam de exame os alunos com média ponderada não inferior a 10 valores.
- Testes e Exame final: Provas **sem** consulta. O material para os testes **não** é cumulativo. Existirá um teste sobre o capítulo 2 e outro teste sobre os capítulos 3, 4 e 5. Em princípio, a data da realização do teste #1 será uma semana após a conclusão da matéria do capítulo 2.
- Os grupos são de 2, 3 ou 4 alunos (a confirmar, dependendo da dimensão da turma). Este trabalho de aplicação das técnicas estudadas é de tema livre e implica a recolha de dados para análise. O tópico é a regressão com séries temporais (capítulo 2). Os resultados do trabalho serão apresentados oralmente, em sessão conjunta, no final do semestre (datas a definir). A versão escrita do trabalho poderá ser entregue até uma semana após o último dia de aulas. Trabalhos entregues fora do prazo não serão considerados. Mais informações sobre o trabalho de grupo serão dadas no decorrer do semestre.

Outras Informações:

1. **Lista de Software:**

- EViews 5 da Quantitative MicroSoftware, <http://www.eviews.com/>
- EasyReg International (gratuito), de Herman Bierens, PSU, <http://econ.la.psu.edu/~hbierens/EASYREG.HTM>

2. **Dados:**

- <http://www.swcollege.com/bef/wooldridge/wooldridge2e/wooldridge2e.html>
- website da disciplina

3. Material a ser disponibilizado no **Website e na Plataforma E-Learning** (entre outros):

- Slides/Apontamentos;
- Trabalho de grupo;
- Links para a obtenção de dados;
- ...

4. **Descritores de Dublin** (ver Ficha de Unidade Curricular no Fénix)