



Universidade do Minho

Econometria II

Licenciatura em Economia, 2.º ano, 2.º Semestre
Universidade do Minho, 2007–2008

EQUIPE DOCENTE

Aulas teóricas

NATÁLIA BARBOSA

Universidade do Minho
Escola de Economia e Gestão
Departamento de Economia
Gualtar
4710 – 057 Braga
Tel. +351 253 604 535
Fax +351 253 676 375
Email: natbar@eeg.uminho.pt
Homepage:
<http://nataliamcbarbosa.googlepages.com/>

Aulas teórico-práticas

MIGUEL PORTELA

Universidade do Minho
Escola de Economia e Gestão
Departamento de Economia
Gualtar
4710 – 057 Braga
Tel. +351 253 604 510 (ext. 5557)
Fax +351 253 676 375
Email: mangelo@eeg.uminho.pt
Homepage: <http://www.eeg.uminho.pt/economia/mangelo/>

OBJECTIVOS DA DISCIPLINA

- Fornecer uma visão do âmbito, objecto e metodologia da econometria;
- Fomentar o uso de métodos econométricos no estudo empírico de fenómenos económicos, demonstrando a sua utilidade e relevância com recurso a exemplos práticos;
- Estimular a análise crítica e fundamentada de estudos empiricamente orientados com referência à interligação entre teoria económica, modelo econométrico e fiabilidade dos resultados obtidos.

PROGRAMA

1. INTRODUÇÃO

- 1.1 Econometria: natureza, objecto e método
- 1.2 Relações teóricas e empíricas
- 1.3 Correlação, causalidade e regressão
- 1.4 Tipologia de modelos econométricos e dados amostrais

2. MODELO DE REGRESSÃO: ESTIMAÇÃO E INFERÊNCIA

Motivação, notação e interpretação
Hipóteses clássicas do modelo
Propriedades do estimador dos mínimos quadrados

Distribuição amostral do estimador dos mínimos quadrados

Testes de hipóteses sobre um parâmetro

Teste a restrições múltiplas: O teste F

3. PREVISÃO

Motivação, notação e premissas

Tipos de previsão e o previsor de mínimos quadrados

Avaliação da capacidade preditiva do modelo: teste de previsão de Chow e medidas da qualidade da previsão

4. VARIÁVEIS ARTIFICIAIS

Introdução: natureza e fundamentação das variáveis artificiais

Formulação, estimação e interpretação de modelos com variáveis artificiais

Teste à alteração de estrutura com recurso a variáveis artificiais

5. ANÁLISE DE ESPECIFICAÇÃO

Erros de especificação

Heteroscedasticidade

Autocorrelação

Multicolinearidade

BIBLIOGRAFIA BÁSICA

- Wooldridge, Jeffrey M. (2000) **Introductory Econometrics, A Modern Approach**, South-Western College Publishing.
- Gujarati, Damodar N. (1995) **Basic Econometrics**, 3rd edition, McGraw-Hill International Editions.
- Gujarati, Damodar N. (2000) **Econometria Básica**, Markon Books (ou edições posteriores)
- Mendes de Oliveira, M.; Aguiar, A.; Carvalho, A.; Martins, F.; Mendes, V.; Portugal, P.(1999) **Econometria: Exercícios**, McGraw-Hill.

Tabela de equivalências entre o Programa da disciplina de Econometria e os manuais indicados como bibliografia básica

Capítulo do Programa	GUJARATI (1995) & GUJARATI (2000)	WOOLDRIDGE (2000)	GREENE (2000)
1. INTRODUÇÃO	1	1	1
2. MODELO DE REGRESSÃO: ESTIMAÇÃO E INFERÊNCIA	2, 3, 4 (excepto 4.4), 5, 7, 8 e 9	2, 3, 4 e 5	2, 3, 4, 5 e 6
3. PREVISÃO	5.10 e 9.9	6.4	6
4. VARIÁVEIS ARTIFICIAIS	15	7	7.2
5. ANÁLISE DE ESPECIFICAÇÃO	10, 11, 12, 13	8, 9 e 12	11, 12

ATENDIMENTO A ALUNOS

Durante o período lectivo o atendimento a alunos far-se-á no seguinte horário:

Natália Barbosa 2ª feira: 10h00-13h00, Gabinete 2.23, Escola de Economia e Gestão

Miguel Portela 5ª feira: 10h30-12h00; 6ª-feira: 10h30-12h00, Gabinete 2.08, Escola de Economia e Gestão

O atendimento fora do horário indicado ou durante o período não lectivo far-se-á mediante marcação prévia com a docente.

FICHA INDIVIDUAL

A ficha individual de identificação deverá ser entregue impreterivelmente até ao dia **11 de Março** de 2008.

AVALIAÇÃO

A avaliação à unidade curricular obedece aos critérios e metodologias definidos pela Universidade do Minho. A assiduidade, pontualidade e participação dos alunos nas aulas são fortemente recomendadas. A avaliação de conhecimentos consistirá na realização de

- **Trabalho de grupo** com ponderação de **40%** e com entregas parcelares a **19 de Abril** de 2008 e a **6 de Junho** de 2008
- **Teste escrito** com ponderação de **60%** e a realizar entre **9 e 20 de Junho** de 2008.

Trabalho de grupo

O trabalho de grupo (3 a 4 alunos) que se propõe é a aplicação prática de conhecimentos econométricos adquiridos na disciplina. Pretende-se que os alunos usem os conhecimentos de econometria adquiridos nas aulas teóricas e os apliquem num caso prático com recurso ao software econométrico STATA. Este software será brevemente introduzido no decurso das aulas práticas. A escolha do tema do trabalho será da responsabilidade dos alunos e deverá ser feita de entre um número limitado de possibilidades apresentadas **na primeira aula prática**. O tema e respectiva base de dados a ser fornecida pelo docente será comum às duas fases em que o trabalho se desenvolve. Para além do programa previamente definido para as aulas práticas, estas serão também uma oportunidade para os alunos procurarem junto do docente esclarecer algumas dúvidas associadas à realização do trabalho.

O trabalho será realizado em duas fases distintas. Na primeira fase, a qual deverá estar concluída a **19 de Abril de 2008**, os alunos deverão trabalhar um conjunto de tópicos/questões previamente definidos pelo docente e iguais para todos os alunos. Na segunda fase com data limite de **6 de Junho de 2008**, os alunos escolhem as questões/tópicos que pretendem abordar, não havendo qualquer restrição ao número e tipo de questões a trabalhar. Procura-se, nesta fase de execução

do trabalho, que os alunos sejam originais e inovadores no tipo de questões a trabalhar, procurando replicar alguns aspectos de trabalhos econométricos que abordem o mesmo tema mas que usem outros dados empíricos ou explorando as características particulares dos dados disponíveis dando resposta a questões que julguem pertinentes. Naturalmente, o enquadramento teórico para a realização desta fase do trabalho é o que resulta da exposição nas aulas teóricas.

O documento final em cada uma das fases, o qual será objecto de avaliação, deverá ter uma **dimensão máxima de 20 páginas** e ser formatado com letra tipo Times New Roman, dimensão 12, espaço de 1,5 entre linhas e margens de 2,5 cms. A primeira página do documento deverá conter a seguinte informação: referência à licenciatura e à disciplina, título do trabalho, identificação dos autores, e resumo do trabalho. As restantes páginas deverão ser estruturadas de forma a conterem uma breve descrição do tema em análise, referência aos elementos essenciais da teoria económica relevante, especificação do modelo econométrico a estimar (se aplicável), indicação das hipóteses a testar (se aplicável), descrição da amostra usada, análise e comentário dos resultados obtidos.

Os critérios de avaliação são: originalidade, clareza, consistência, e coerência da argumentação apresentada, enquadramento com os tópicos discutidos durante as aulas e, estruturação e correcção do documento escrito. Para poder ser considerado como elemento de avaliação a primeira parte do trabalho deverá ser entregue até ao dia **19 de Abril** de 2008 e a segunda parte até ao dia **6 de Junho** de 2008.

Data importante a reter

14 de Março de 2008 – Entrega de um documento com a identificação do grupo de alunos e título provisório do trabalho a realizar.

Presença efectiva em aula

Em conformidade do nº 9, art. 2º do Regulamento de Inscrição, Avaliação e Passagem de Ano (RIAPA) a presença em, pelo menos, 2/3 das aulas efectivamente leccionadas é obrigatória. Para o efeito, em cada aula leccionada os alunos deverão registar a sua presença na folha de presenças que será disponibilizada pelo docente. É da inteira responsabilidade do aluno proceder a esse registo, o qual apenas poderá ser feito durante o decurso das aulas. A contagem das presenças em aula será efectuada até ao dia **30 de Maio de 2008** (inclusive). No dia 2 de Junho de 2008 será divulgada a lista dos alunos que não cumprem o disposto no nº 9, art. 2º, e cuja consequência é a impossibilidade de se submeterem a avaliação da unidade curricular em qualquer momento do ano lectivo 2007-2008. Naturalmente, ter-se-á em consideração os alunos devidamente enquadrados nos regimes especiais de frequência referidos no art. 19 do RIAPA. A apresentação de justificações devidamente documentadas para eventual relevação de faltas só serão aceites até ao dia 6 de Junho de 2008.