



UNIVERSIDADE LUSÍADA DE LISBOA

Programa da Unidade Curricular

ECONOMETRIA

Ano Lectivo 2014/2015

1. Unidade Orgânica

Ciências da Economia e da Empresa (1º Ciclo)

2. Curso

Economia

3. Ciclo de Estudos

1º

4. Unidade Curricular

ECONOMETRIA (03316)

5. Área Científica

6. Ano curricular

2º

7. Tipo de Unidade Curricular / Semestre

2º Semestre



UNIVERSIDADE LUSÍADA DE LISBOA

8. Tipo de aula e carga horária (tempo de trabalho)

Aulas Teóricas:	
Aulas Práticas:	
Aulas Teórico-práticas:	30,00
Orientação Tutorial:	20,00

9. Créditos

6,00

10. Coordenador da Área Científica

11. Regente

Dr. FERNANDO MANUEL MONTEIRO MARTINS

12. Assistentes

13. Língua de ensino

Português

14. Objectivos Gerais

O conteúdo programático desta unidade curricular tem por objectivo geral fornecer os princípios elementares da econometria.

15. Objectivos Específicos

O conteúdo desta unidade curricular parte dos conceitos básicos de análise de regressão e evolui no sentido de enquadrar, gradualmente, um vasto conjunto de técnicas e ferramentas de análises econométrica, em particular, ensaios de hipóteses, previsão, permanência de estrutura, variáveis auxiliares, heteroscedasticidade e autocorrelação.

16. Competências a adquirir

Familiarizar os alunos com os principais conceitos introdutórios da econometria. Assim, após a frequência desta unidade curricular, os alunos devem conseguir formalizar um problema de natureza económica, recolher informação em bases de dados nacionais e internacionais e, com base no modelo de regressão linear e software específico, construir modelos, testar a sua validade e fazer previsão.

17. Metodologia de ensino

De forma a cumprir os objectivos expostos a leccionação é feita em aulas teórico-práticas e aulas de orientação tutorial. Nas aulas teórico-práticas é feita a apresentação dos diferentes pontos da matéria a qual é completada com a respectiva componente prática. Nas aulas de orientação tutorial são discutidos os principais pontos do programa bem como orientar os alunos para a realização de trabalhos práticos.



UNIVERSIDADE LUSÍADA DE LISBOA

18. Conteúdos Programáticos

Capítulo I - Modelo de Regressão Linear Múltiplo (MRLM)

- 1.1. Introdução: Motivação
- 1.2. Hipóteses do Modelo de Regressão Linear Múltiplo.
- 1.3. Mínimos Quadrados Ordinários (OLS - Ordinary Least Squares).
- 1.4. Propriedades dos estimadores dos mínimos quadrados.
- 1.5. Funções não lineares mas linearizáveis: Formas Funcionais.
- 1.6. Soma de Quadrados e sua decomposição. Coeficiente de Determinação.
- 1.7. Critérios de discriminação de modelos

Capítulo II - Inferência no modelo de Regressão: Ensaios e Previsão

- 2.1. Teste de validade global.
- 2.2. Ensaios de hipóteses sobre os coeficientes (rácios-t).
- 2.3. Ensaio de melhoramento.
- 2.4. Restrições lineares sobre os coeficientes - Ensaios
- 2.5. Intervalos de confiança para os parâmetros da regressão.
- 2.6. Previsão e intervalos de previsão.

Capítulo III - Permanência de estrutura e variáveis dummy

- 3.1. Introdução.
- 3.2. Ensaios sobre permanência de estrutura
- 3.3. Variáveis auxiliares explicativas. Definição, utilização e exemplos.
- 3.4. Construção de modelos com variáveis auxiliares.

Capítulo IV - Violação das hipóteses do MRLM: Detecção e correção

- 4.1. Introdução
- 4.2. Heteroscedasticidade e normalidade
- 4.3. Autocorrelação

19. Métodos de Avaliação

Regulamento Geral de Avaliação com relevância para testes, assiduidade e trabalhos. Serão tomados em consideração na avaliação o interesse demonstrado bem como todo o trabalho dedicado pelo aluno a esta unidade curricular.

20. Recursos Didáticos

A exposição da matéria será feita com recurso a Power-Point e software que permite toda a modelização econometrica leccionada. A disciplina contará com uma pagina WEB a qual disponibilizará um conjunto de exercícios para os alunos resolverem.

21. Palavras Chave

Econometria
Modelo de Regressão Linear
OLS
Economia Aplicada



UNIVERSIDADE LUSÍADA DE LISBOA

23. Bibliografia Principal

Autor(es): GUJARATI, Damodar
Título: Basic Econometrics
Edição: 4.^a Ano: 2003
Local:
Editora: McGraw-Hill

Autor(es): WOOLDRIDGE, Jeffrey
Título: Introductory Econometrics: A Modern Approach
Edição: Ano: 2003
Local:
Editora: South-Western College Publishing

Autor(es): STEWART, Jon and GILL, Len
Título: Econometrics
Edição: 2.^a Ano: 1998
Local:
Editora: Prentice Hall

24. Bibliografia Complementar

Autor(es):
Título:
Edição: Ano:
Local:
Editora:

Autor(es):
Título:
Edição: Ano:
Local:
Editora:



UNIVERSIDADE LUSÍADA DE LISBOA

Ficha técnica MIP	
Título	Programa da unidade curricular 'ECONOMETRIA': Ano Lectivo 2014/2015
Autor	Dr. FERNANDO MANUEL MONTEIRO MARTINS
Classificação	-
Descritores	-
Colaborador(es)	-
Data/Hora	30-07-2014 18:16:00
Formato de dados	Texto, PDF
Estatuto de utilização	Acesso público
Relação	Versão 1,0
(c) Universidade Lusíada de Lisboa, 2014	