UNIVERSIDADE LUSÍADA DE LISBOA

Programa da Unidade Curricular
ECONOMETRIA

Ano Lectivo 2022/2023

1. Unidade Orgânica

Faculdade de 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

FUNDAÇÃO MINERVA CULTURA - ENSINO E INVESTIGAÇÃO CIENTÍFICA

Rua da Junqueira, 188 a 198 - 1349-001 LISBOA - Telefone 213 611 500 - Fax 213 638 307 - e-mail: info@lis.ulusiada.pt - http://www.lis.ulusiada.pt

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

Prof. Doutor HELDER MANUEL GOMES DOS REIS

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 tuorial são discutidos os principais pontos do programa bem como orientar os alunos para a realização de trabalhos práticos.

FUNDAÇÃO MINERVA CULTURA - ENSINO E INVESTIGAÇÃO CIENTÍFICA

Rua da Junqueira, 188 a 198 - 1349-001 LISBOA - Telefone 213 611 500 - Fax 213 638 307 - e-mail: info@lis.ulusiada.pt - http://www.lis.ulusiada.pt

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 e utilização.
3.4. Construção de modelos com variáveis auxiliares.
Capítulo IV - Violação das hipóteses do MRLM: Detecção e correcção
4.1. Introdução
4.2. Heteroscedasticidade e normalidade
4.3. Autocorrelação

19. Métodos de Avaliação

A nota de avaliação contínua resulta da média ponderada de dois testes a realizar (50% cada).

20. Recursos Didácticos

A exposição da matéria será feita com recurso a Power-Point e software que permite toda a modelização econométrica lecionada, bem como a lecionação online sempre que necessário, tendo em conta as circunstâncias excecionais que o país atravessa.

21. Palavras Chave

Econometria
Modelo de Regressão Linear
OLS
Economia Aplicada

FUNDAÇÃO MINERVA CULTURA - ENSINO E INVESTIGAÇÃO CIENTÍFICA

Rua da Junqueira, 188 a 198 - 1349-001 LISBOA - Telefone 213 611 500 - Fax 213 638 307 - e-mail: info@lis.ulusiada.pt - http://www.lis.ulusiada.pt

23. Bibliografia Principal

Autor(es):	GUJARATI, Damodar and PORTER, Dawn		
Titulo:	Basic Econometrics		
Edição:	5.ª	Ano:	2010
Local:			
Editora:	McGraw-Hill		

Autor(es):	WOOLDRIDGE, Jeffrey		
Titulo:	Introductory Econometrics: A Modern Approach		
Edição:	5.ª	Ano:	2009
Local:			
Editora:	South-Western College Publishing		

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

24. Bibliografia Complementar

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

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

FUNDAÇÃO MINERVA CULTURA - ENSINO E INVESTIGAÇÃO CIENTÍFICA

Rua da Junqueira, 188 a 198 - 1349-001 LISBOA - Telefone 213 611 500 - Fax 213 638 307 - e-mail: info@lis.ulusiada.pt - http://www.lis.ulusiada.pt

UNIVERSIDADE LUSÍADA DE LISBOA

Ficha técnica MIP	
Título	Programa da unidade curricular 'ECONOMETRIA': Ano Lectivo 2022/2023
Autor	Prof. Doutor HELDER MANUEL GOMES DOS REIS
Classificação	-
Descritores	-
Colaborador(es)	-
Data/Hora	29-08-2022 11:35:00
Formato de dados	Texto, PDF
Estatuto de utilização	Acesso público
Relação	Versão 1,0

(c) Universidade Lusíada de Lisboa, 2022

FUNDAÇÃO MINERVA CULTURA - ENSINO E INVESTIGAÇÃO CIENTÍFICA

Rua da Junqueira, 188 a 198 - 1349-001 LISBOA - Telefone 213 611 500 - Fax 213 638 307 - e-mail: info@lis.ulusiada.pt - http://www.lis.ulusiada.pt