



UNIVERSIDADE LUSÍADA
LISBOA

Programa da Unidade Curricular
ECONOMETRIA

Ano Lectivo 2023/2024

1. Unidade Orgânica

Faculdade de Ciências da Economia e da Empresa

2. Curso

ECONOMIA

3. Ciclo

1º

4. Unidade Curricular

ECONOMETRIA (03316)

5. Área Científica

6. Ano Curricular

2º

7. Tipo de Unidade Curricular / Semestre

2º Semestre



UNIVERSIDADE LUSÍADA
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 ECTS

6,00

10. Coordenador da Área Científica

11. Regente

Prof. Doutor HELDER MANUEL GOMES DOS REIS

12. Assistentes

13. Língua de Ensino

Português

14. Objetivos Gerais

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

15. Objetivos 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 respetiva componente prática. Nas aulas de orientação tutorial são discutidos os principais pontos do programa bem como orientar os alunos para a realização de casos práticos.



UNIVERSIDADE LUSÍADA
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 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 Didáticos

A exposição dos temas do programa será feita com recurso a Power-Point e software que permite a modelização econométrica.

21. Objetivos de Sustentabilidade

No decorrer da unidade curricular a metodologia de trabalho terá em atenção os objetivos de desenvolvimento sustentável, com destaque para o objetivo 4, procurando assegurar educação inclusiva e de qualidade para todos, e para o objetivo 8, promover o crescimento económico inclusivo e sustentável, o emprego pleno e produtivo e o trabalho digno para todos.

22. Palavras Chave

Econometria
Modelo de Regressão Linear
OLS
Economia Aplicada



UNIVERSIDADE LUSÍADA
LISBOA

23. Bibliografia Principal

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

Autor(es): WOOLDRIDGE, Jeffrey
Título: Introductory Econometrics: A Modern Approach
Edição: 7.^a Ano: 2019
Local:
Editora: Cengage Learning

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
LISBOA

Ficha técnica MIP / MIP Datasheet	
Título / Title	Programa da unidade curricular 'ECONOMETRIA': Ano Lectivo 2023/2024
Autor / Author	Prof. Doutor HELDER MANUEL GOMES DOS REIS
Classificação / Classification	-
Descritores / Descriptors	-
Colaborador(es) / Colaborator(s)	-
Data Hora / Date Time	25-07-2023 14:21:00
Formato de dados / Data Format	Texto / Text, PDF
Estatuto de utilização / Usage	Acesso público / Public Access
Relação / Relation	Versão 1,0
(c) Universidade Lusíada, 2024	