UNIVERSIDADE LUSÍADA
LISBOA

Programa da Unidade Curricular
ECONOMETRIA

Ano Lectivo 2025/2026

## 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

1º 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 - https://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 ECTS

6,00

## 10. Coordenador da Área Cientifica

## 11. Regente

Prof. Doutor FERNANDO MANUEL MONTEIRO MARTINS

## 12. Assistentes

## 13. Língua de Ensino

Português

## 14. Objetivos Gerais

O conteúdo programático desta unidade curricular tem por objectivo 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

Aplicar métodos de regressão múltipla
Identificar as fragilidades dos modelos econométricos
Interpretar resultados estatísticos
Testar hipóteses económicas
Utilizar o software econométrico R
Avaliar a validade de modelos
Aplicar métodos estatísticos a dados de painel

## 17. Metodologia de Ensino



**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 - https://www.lis.ulusiada.pt

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.

## 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 correcção
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 PowerPoint
Utilização do software R e, pontualmente, do Excel e do SPSS
Acesso a bases de dados de referência na área económica: INE, Banco de Portugal, Eurostat, Banco Central Europeu e FMI.

## 21. Objetivos de Sustentabilidade



**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 - https://www.lis.ulusiada.pt

Garantir o acesso a uma educação inclusiva, de qualidade e equitativa, promovendo oportunidades de aprendizagem para todos os alunos independentemente do seu ponto de partida no domínio dos conceitos

Dotar os alunos de ferramentas que promovam a sua empregabilidade, nomeadamente nas áreas da economia e gestão. O domínio de técnicas econometricas são uma enorme mais-valia.

Dotar os alunos de ferramentas que lhes permita a possibilidade de formularem problemas com elevado conteúdo inovador.

## 22. 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 - https://www.lis.ulusiada.pt

## 23. Bibliografia Principal

| | | | |
|---|---|---|---|
| Autor(es): | HEISS, Florian | | |
| Título: | Using R for Introductory Econometrics | | |
| Edição: | 2.ª | Ano: | 2020 |
| Local: | | | |
| Editora: | CreateSpace Independent Publishing Platform | | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| Autor(es): | WOOLDRIDGE, Jeffrey | | |
| Título: | Introductory Econometrics: A Modern Approach | | |
| Edição: | 8ª | Ano: | 2025 |
| Local: | | | |
| Editora: | South-Western College Publishing | | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| Autor(es): | STOCK, James e WATSON, Mark W. | | |
| Título: | Introduction to Econometrics | | |
| Edição: | 4.ª | Ano: | 2018 |
| Local: | | | |
| Editora: | Pearson | | |

## 24. Bibliografia Complementar

| | | | |
|---|---|---|---|
| Autor(es): | GREENE, W. H. | | |
| Título: | Econometric Analysis | | |
| Edição: | 8ª Pearson | Ano: | 2018 |
| Local: | | | |
| Editora: | Pearson | | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| Autor(es): | CAMERON, A. C., TRIVEDI, P. K. | | |
| Título: | Microeconometrics Using Stata | | |
| Edição: | 2ª | Ano: | 2022 |
| Local: | | | |
| Editora: | Stata Pres | | |



**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 - https://www.lis.ulusiada.pt

UNIVERSIDADE LUSÍADA
LISBOA

| Ficha técnica MIP / MIP Datasheet | |
|---|---|
| Título / Title | Programa da unidade curricular 'ECONOMETRIA': Ano Lectivo 2025/2026 |
| Autor / Author | Prof. Doutor FERNANDO MANUEL MONTEIRO MARTINS |
| Classificação / Classification | - |
| Descritores / Descriptors | - |
| Colaborador(es) / Colaborator(s) | - |
| Data Hora / Date Time | 29-06-2025 11:24:00 |
| Formato de dados / Data Format | Texto / Text, PDF |
| Estatuto de utilização / Usage | Acesso público / Public Access |
| Relação / Relation | Versão 1,0 |

(c) Universidade Lusíada, 2025



**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 - https://www.lis.ulusiada.pt