

ISEG - INSTITUTO SUPERIOR DE ECONOMIA E GESTÃO
Universidade de Lisboa

Econometria
Licenciaturas em Economia e Finanças
2º Semestre - 2014/2015

OBJECTIVOS DA DISCIPLINA

Consolidar e desenvolver conhecimentos sobre estimação e inferência de mínimos quadrados (OLS), para aplicação a modelos de regressão linear, para dados seccionais e para séries temporais.

Estudar modelos seccionais com variáveis binárias. Estudar modelos básicos para séries temporais, com destaque para os problemas de não estacionaridade.

Familiarizar os estudantes com aplicações empíricas e com a utilização de software de econometria (EViews).

PROGRAMA

1ª Parte: Análise de Regressão com Dados Seccionais - Continuação

1. Informação Qualitativa: Variáveis Binárias (“Dummy”)

- 1.1 Descrição de informação qualitativa (W7.1)
- 1.2 Uma única variável *dummy* (W7.2)
- 1.3 Variáveis *dummy* para várias categorias (W7.3)
- 1.4 Interações envolvendo variáveis *dummy* (W7.4)

2. Modelos para Variáveis Dependentes Binárias

- 2.1 O modelo linear de probabilidades (W7.5 e W8.5)
- 2.2 Os modelos *logit* e *probit* (W17.1)

2ª Parte: Análise de Regressão com Séries Temporais

3. Análise de Regressão Básica

- 3.1 A natureza dos dados de séries temporais (W10.1)
- 3.2 Exemplos de modelos de regressão de séries temporais (W10.2)
- 3.3 Propriedades do OLS em pequenas amostras sob as hipóteses clássicas (W10.3)
- 3.4 Forma funcional e variáveis *dummy* (W10.4)
- 3.5 Tendências e sazonalidade (W10.5)

4. Tópicos Adicionais sobre a Utilização do OLS

- 4.1 Séries temporais estacionárias e fracamente dependentes (W11.1)
- 4.2 Propriedades assintóticas do OLS (W11.2)
- 4.3 Séries temporais altamente persistentes na análise de regressão (W11.3)
- 4.4 Modelos dinamicamente completos e a ausência de autocorrelação (W11.4)

5. Autocorrelação

5.1 Propriedades do OLS com erros autocorrelacionados (W12.1)

5.2 Testes de autocorrelação (W12.2)

5.3 Diferenciação e autocorrelação (W12.4)

6 Tópicos Avançados

6.1 Testes de raiz unitária (W18.2)

6.2 Regressões espúrias (W18.3)

6.3 Cointegração e modelos de correcção do erro (W18.4)

6.4 Previsão (W18.5)

BIBLIOGRAFIA

- **Básica**

- Wooldridge, J. M. (2009) [W], [*Introductory Econometrics: a Modern Approach*](#), 4th. ed., South Western. [W]

- **Complementar**

- Stock, J. H e Watson, M. W. (2007), *Introduction to Econometrics*, 2nd ed., Pearson, Addison Wesley.

AVALIAÇÃO DE CONHECIMENTOS

- **Provas escritas individuais** - constituem a componente fundamental da avaliação de conhecimentos. Estas provas realizam-se nas épocas previstas pelo RGAC: normal, de recurso e especial. Estas provas poderão ter questões de carácter eliminatório, bem como questões de escolha múltipla com penalização para as respostas erradas
Para efeitos de obtenção de nota positiva, nenhuma das provas escritas será complementada por uma prova oral.
- **Consulta** - na realização das provas escritas referidas acima os estudantes poderão utilizar os seguintes elementos de consulta:
 - um formulário que não poderá conter mais de 8 (oito) páginas (4 folhas) de formato A4
 - as tabelas estatísticasEstes elementos de consulta não são fornecidos pela equipa docente. Não será permitida a realização da prova aos alunos cujos elementos de consulta excedam os referidos. Também não será permitida a realização da prova aos alunos cujos formulários contenham caracteres com dimensão muito reduzida ou cópias fotográficas (fotocópias) obtidas com redução.
- **Identificação** - Para acederem à realização das provas escritas, os estudantes deverão ser portadores de BI ou cartão de cidadão ou equivalente, atualizado, com fotografia e assinatura claramente visíveis.
- **Classificação superior a 17 valores** - Os alunos que obtenham classificação superior a 17 valores em qualquer das provas referidas serão solicitados a realizar uma prova complementar de carácter individual, que poderá consistir num trabalho escrito ou numa prova oral. A não realização desta prova complementar implica a classificação final de 17 valores (que também é a classificação mínima assegurada aos alunos que a realizarem).

- Se nalguma das épocas especiais de exame o número de alunos inscritos for inferior ou igual a 10, a prova escrita poderá ser substituída por uma prova oral.

EQUIPA DOCENTE

Docente	Contacto	Tipo de Aulas	Turnos	Horário de atendimento
Isabel Proença (Responsável)	isabelp@iseg.ulisboa.pt Gab. 201, Quelhas 2	Teóricas	A02	Contatar a docente
Luizete Reis	lreis@iseg.ulisboa.pt Gab. 107, Quelhas 4	Práticas	M06 M07 M08	Contatar a docente

PROGRAMAÇÃO DAS AULAS

Capítulo do Programa	Teóricas	Práticas
1ª Parte	8	5
1. Informação Qualitativa: Variáveis Binárias (“Dummy”)	5	3
2. Modelos para Variáveis Dependentes Binárias	3	2
2ª Parte	16	8
3. Análise de Regressão Básica	4	2
4. Tópicos Adicionais sobre a Utilização do OLS	4	2
5. Autocorrelação	2	1
6 Tópicos Avançados	6	3
Total	24	13
Total de aulas disponíveis	25	13

Responsável:

Isabel Proença

 Email: isabelp@iseg.ulisboa.pt